

易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	10
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	11
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	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
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	63
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	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 盈利投资者数量占比	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 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
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	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	67
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 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	951,705,064.92 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	486,716,261.01 份	464,988,803.91 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	广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510627；510623；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	225,946,037.58	214,262,012.55
本期利润	329,099,922.75	297,484,800.97
加权平均基金份额本期利润	0.7369	0.6935
本期加权平均净值利润率	37.19%	35.04%
本期基金份额净值增长率	53.53%	53.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026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	431,496,788.88	406,579,604.34
期末可供分配基金份额利润	0.8865	0.8744

期末基金资产净值	1,153,855,193.67	1,095,742,812.26
期末基金份额净值	2.3707	2.3565
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 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	137.07%	135.65%

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
过去三个月	34.25%	1.82%	10.48%	1.11%	23.77%	0.71%
过去六个月	53.53%	1.68%	8.19%	1.03%	45.34%	0.65%
过去一年	120.69%	1.50%	25.33%	0.92%	95.36%	0.58%
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	137.07%	1.44%	25.12%	0.92%	111.95%	0.52%

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
过去三个月	34.11%	1.83%	10.48%	1.11%	23.63%	0.72%
过去六个月	53.24%	1.68%	8.19%	1.03%	45.05%	0.65%
过去一年	119.86%	1.50%	25.33%	0.92%	94.53%	0.58%
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	135.65%	1.44%	25.12%	0.92%	110.53%	0.52%

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 2026 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



§ 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 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、易方达瑞祺混合、易方达悦安一年持有债券、易方达研究智选股票的基金经理，研究部总经理助理、行业研究员	2024-12-11	-	9 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》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后

监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股主要宽基指数上行，中证 800 指数上涨 11.12%，但市场结构分化达到近年较高水平：人工智能产业链相关行业大幅上涨，多数传统行业下跌，行业间收益差明显拉大。风格因子维度，一季度价值与周期类因子相对占优，二季度成长、动量等进攻型因子表现强势，价值、红利与低波动类因子明显承压，因子表现的切换与横截面收益离散度的放大并存。

上半年组合的工作围绕两条线索展开。一季度以策略迭代优化为重心：识别并剔除高频轮动环境中受噪音污染的短期信号，精细化控制交易冲击成本与滑点损耗，并根据市场状态动态调节风险预算。二季度，组合延续多源信号融合的选股框架，在既定跟踪误差预算内运作，模型对成长与盈利改善方向的暴露对超额收益形成了主要贡献；同时我们加强了对拥挤度与流动性指标的监控，在涨幅较大、交易集中的方向上通过约束条件控制单一行业与风格的过度集中，借助交易成本模型抑制换手过程中的冲击损耗。组合整体运作坚持以因子有效性为基础、交易质量为保障、风险预算为调节器的逻辑，力求超额收益的积累过程平滑、可持续。

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 2.3707 元，本报告期份额净值增长率为 53.53%，同期业绩比较基准收益率为 8.19%；C 类基金份额净值为 2.3565 元，本报告期份额净值增长率为 53.24%，同期业绩比较基准收益率为 8.19%。

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，市场活跃度与结构性机会有望延续，成长方向预计仍是重要主线，这一环境总体上有利于选股策略发挥；但也需要看到，部分方向经过大幅上涨后交易拥挤度上升，市场波动与风格轮动可能加大，对模型的适应性与风险控制的精细度提出更高要求。因子层面，若市场风险偏好

维持，成长与动量类因子的相对优势可能延续，但需防范拥挤交易的回吐风险；若波动放大、风格趋于均衡，质量、价值与低波类因子或有修复机会，其他主题方向亦可能阶段性表现。组合将继续在跟踪误差预算内保持适度主动暴露，通过多元化的信号来源与严格的风险约束应对可能的风格切换，力争为投资者获取持续、稳健的超额回报。

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遵规守信、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 2026 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：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	197,682,818.75	21,827,436.01
结算备付金		23,676,634.38	441,972.05
存出保证金		1,198,469.75	30,237.72
交易性金融资产	6.4.7.2	2,072,429,842.12	150,106,570.22
其中：股票投资		2,069,671,920.04	150,106,570.22
基金投资		-	-
债券投资		2,757,922.08	-
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		52,179,152.44	-
应收股利		8,369.77	-
应收申购款		1,741,375.51	3,836,000.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,348,916,662.72	176,242,216.71
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		69,834,294.12	15,907,581.14
应付赎回款		23,364,523.21	93,224.40
应付管理人报酬		2,160,210.06	102,816.94
应付托管费		180,017.52	8,568.09
应付销售服务费		355,010.72	7,952.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,424,595.70	83,831.32
负债合计		99,318,656.79	16,203,974.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	951,705,064.92	103,756,107.89
未分配利润	6.4.7.8	1,297,892,941.01	56,282,134.69
净资产合计		2,249,598,005.93	160,038,242.58
负债和净资产总计		2,348,916,662.72	176,242,216.71

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.3707 元，C 类基金份额净值 2.3565 元；基金份额总额 951,705,064.92 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 486,716,261.01 份，C 类基金份额总额 464,988,803.91 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：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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		639,417,960.36	2,046,814.69
1.利息收入		267,742.82	2,456.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	267,742.82	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）		451,397,086.24	1,229,911.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	441,352,466.96	1,091,520.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	183.29	-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	10,044,435.99	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	186,376,673.59	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	1,376,457.71	820.87
减：二、营业总支出		12,833,236.64	119,473.00
1. 管理人报酬		10,235,118.91	109,203.26
2. 托管费		852,926.56	9,100.27
3. 销售服务费		1,669,830.05	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		0.76	-
8. 其他费用	6.4.7.18	75,360.36	244.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		626,584,723.72	1,927,341.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		626,584,723.72	1,927,341.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		626,584,723.72	1,927,341.69

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	103,756,107.89	56,282,134.69	160,038,242.58
二、本期期初净资产	103,756,107.89	56,282,134.69	160,038,242.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	847,948,957.03	1,241,610,806.32	2,089,559,763.35
（一）、综合收益总额	-	626,584,723.72	626,584,723.72
（二）、本期基金	847,948,957.03	615,026,082.60	1,462,975,039.63

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,203,393,011.39	966,927,563.75	2,170,320,575.14
2.基金赎回款	-355,444,054.36	-351,901,481.15	-707,345,535.51
（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	951,705,064.92	1,297,892,941.01	2,249,598,005.93
项目	上年度可比期间 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

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>》，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	197,682,818.75
等于：本金	197,669,581.92
加：应计利息	13,236.83
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	197,682,818.75

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	1,878,647,042.08	-	2,069,671,920.04	191,024,877.96

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,277,399.82	189.70	2,757,922.08	1,480,332.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,277,399.82	189.70	2,757,922.08	1,480,332.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,879,924,441.90	189.70	2,072,429,842.12	192,505,210.52

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	19,739.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,342,869.60
其中：交易所市场	3,342,869.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,987.07

合计	3,424,595.70
----	--------------

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	
	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	76,736,099.88	76,736,099.88
本期申购	531,865,682.89	531,865,682.89
本期赎回（以“-”号填列）	-121,885,521.76	-121,885,521.76
本期末	486,716,261.01	486,716,261.01

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	
	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	27,020,008.01	27,020,008.01
本期申购	671,527,328.50	671,527,328.50
本期赎回（以“-”号填列）	-233,558,532.60	-233,558,532.60
本期末	464,988,803.91	464,988,803.91

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	30,228,003.36	11,523,862.64	41,751,866.00
本期期初	30,228,003.36	11,523,862.64	41,751,866.00
本期利润	225,946,037.58	103,153,885.17	329,099,922.75
本期基金份额交易产生的变动数	175,322,747.94	120,964,395.97	296,287,143.91
其中：基金申购款	256,994,023.76	165,328,504.00	422,322,527.76
基金赎回款	-81,671,275.82	-44,364,108.03	-126,035,383.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	431,496,788.88	235,642,143.78	667,138,932.66

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	10,483,710.88	4,046,557.81	14,530,268.69
本期期初	10,483,710.88	4,046,557.81	14,530,268.69
本期利润	214,262,012.55	83,222,788.42	297,484,800.97
本期基金份额交易产生的变动数	181,833,880.91	136,905,057.78	318,738,938.69
其中：基金申购款	324,258,963.77	220,346,072.22	544,605,035.99
基金赎回款	-142,425,082.86	-83,441,014.44	-225,866,097.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,579,604.34	224,174,404.01	630,754,008.35

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	224,071.95
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	25,573.70
其他	18,097.17
合计	267,742.82

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	441,352,466.96
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	441,352,466.96

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	11,190,860,575.31
减：卖出股票成本总额	10,737,141,033.49
减：交易费用	12,367,074.86
买卖股票差价收入	441,352,466.96

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	183.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	183.29

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,044,435.99
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	10,044,435.99

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	186,376,673.59
——股票投资	184,896,341.03
——债券投资	1,480,332.56
——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	186,376,673.59

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	1,376,457.71
合计	1,376,457.71

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	2,479.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	1,409.10
银行间账户维护费	5,233.65
银行汇划费	6,730.54
合计	75,360.36

注：本报告期内，基金管理人自主承担本基金的银行间账户维护及查询费 3,766.35 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、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、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	4,660,812,981.34	19.70%	997,110.50	0.44%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	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	997,855.69	20.80%	967,948.70	28.96%
关联方名称	上年度可比期间			
	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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 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	10,235,118.91	109,203.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,836,193.40	-
应支付基金管理人的净管理费	7,398,925.51	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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 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	852,926.56	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 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	-	329,927.20	329,927.20
广发证券	-	19,891.20	19,891.20
易方达财富	-	24,913.72	24,913.72
合计	-	374,732.12	374,732.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

份额单位：份

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	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	-	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	-	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.0546%	-	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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1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
中国工商银行-活期存款	197,682,818.75	224,071.95	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

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 1 月 1 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
-	-	-	-	-	-

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 0.00 元（上年度可比期间：2,479.45 元）、银行间账户维护及查询费 3,766.35 元（上年度可比期间：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（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	49	1,372.00	1,361.22	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-

				受限						
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
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	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
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	-
30169	三瑞	2026-0	6 个月	新股	24.68	86.80	216	5,330.	18,748	-

6	智能	3-31		流通受限				88	.80	
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	38	1,439.44	1,325.06	-
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	-
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	792	13,875.84	28,448.64	-
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	-
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	-
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	新股流通受限	55.95	57.10	76	4,252.20	4,339.60	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	565	5,350.55	39,629.10	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	820	82,000.00	82,001.26	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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 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 0.12%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	2,757,922.08	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,757,922.08	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限

证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	197,682,818.75	-	-	-	197,682,818.75
结算备付金	23,676,634.38	-	-	-	23,676,634.38
存出保证金	1,198,469.75	-	-	-	1,198,469.75
交易性金融资产	-	-	2,757,922.08	2,069,671,920.04	2,072,429,842.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	52,179,152.44	52,179,152.44
应收股利	-	-	-	8,369.77	8,369.77
应收申购款	-	-	-	1,741,375.51	1,741,375.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	222,557,922.88	-	2,757,922.08	2,123,600,817.76	2,348,916,662.72
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	-	-	-	69,834,294.12	69,834,294.12
应付赎回款	-	-	-	23,364,523.21	23,364,523.21
应付管理人报酬	-	-	-	2,160,210.06	2,160,210.06
应付托管费	-	-	-	180,017.52	180,017.52
应付销售服务费	-	-	-	355,010.72	355,010.72
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5.46	5.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,424,595.70	3,424,595.70
负债总计	-	-	-	99,318,656.79	99,318,656.79

利率敏感度缺口	222,557,922.88	-	2,757,922.08	2,024,282,160.97	2,249,598,005.93
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	21,827,436.01	-	-	-	21,827,436.01
结算备付金	441,972.05	-	-	-	441,972.05
存出保证金	30,237.72	-	-	-	30,237.72
交易性金融资产	-	-	-	150,106,570.22	150,106,570.22
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	-	-	-	3,836,000.71	3,836,000.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,299,645.78	-	-	153,942,570.93	176,242,216.71
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	15,907,581.14	15,907,581.14
应付赎回款	-	-	-	93,224.40	93,224.40
应付管理人报酬	-	-	-	102,816.94	102,816.94
应付托管费	-	-	-	8,568.09	8,568.09
应付销售服务费	-	-	-	7,952.24	7,952.24
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	-	-	-	83,831.32	83,831.32
负债总计	-	-	-	16,203,974.13	16,203,974.13

利率敏感度缺口	22,299,645.78	-	-	137,738,596.80	160,038,242.58
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,069,671,920.04	92.00	150,106,570.22	93.79
交易性金融资产—债券投资	2,757,922.08	0.12	-	-
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	2,072,429,842.12	92.12	150,106,570.22	93.79

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%	155,418,899.08	11,154,235.11
	2.业绩比较基准下降 5%	-155,418,899.08	-11,154,235.11

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	2,070,124,757.20
第二层次	87,056.26
第三层次	2,218,028.66
合计	2,072,429,842.12

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	2,069,671,920.04	88.11
	其中：股票	2,069,671,920.04	88.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,757,922.08	0.12
	其中：债券	2,757,922.08	0.12
	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	221,359,453.13	9.42
8	其他各项资产	55,127,367.47	2.35
9	合计	2,348,916,662.72	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	25,841,045.18	1.15
C	制造业	1,717,786,641.12	76.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	38,160,000.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	97,387,999.22	4.33

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,047,951.92	1.42
J	金融业	35,627,199.40	1.58
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	99,199,214.20	4.41
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	23,616,814.00	1.05
	合计	2,069,671,920.04	92.00

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	002384	东山精密	320,398	84,056,415.30	3.74
2	002975	博杰股份	486,300	69,054,600.00	3.07
3	688686	奥普特	405,969	68,361,119.91	3.04
4	300014	亿纬锂能	1,026,300	66,740,289.00	2.97
5	603259	药明康德	528,900	65,853,339.00	2.93
6	300666	江丰电子	158,000	58,238,800.00	2.59
7	688183	生益电子	394,923	52,287,805.20	2.32
8	688409	富创精密	164,775	50,462,343.75	2.24
9	600060	海信视像	1,750,300	48,780,861.00	2.17
10	601636	旗滨集团	4,627,885	47,343,263.55	2.10
11	300136	信维通信	396,932	47,334,141.00	2.10
12	600176	中国巨石	618,400	45,068,992.00	2.00
13	300201	海伦哲	2,004,300	42,230,601.00	1.88
14	300475	香农芯创	127,200	38,160,000.00	1.70
15	002837	英维克	473,976	37,709,530.56	1.68
16	300943	春晖智控	816,600	36,706,170.00	1.63
17	300285	国瓷材料	346,500	35,751,870.00	1.59
18	002422	科伦药业	912,400	35,145,648.00	1.56
19	002025	航天电器	458,100	34,916,382.00	1.55
20	002643	万润股份	1,655,900	34,691,105.00	1.54
21	000657	中钨高新	356,938	34,166,105.36	1.52

22	300759	康龙化成	1,152,640	33,345,875.20	1.48
23	301018	申菱环境	283,380	32,761,561.80	1.46
24	002484	江海股份	299,600	31,458,000.00	1.40
25	601872	招商轮船	1,722,800	30,269,596.00	1.35
26	603380	易德龙	670,200	30,219,318.00	1.34
27	002001	新和成	1,053,500	29,940,470.00	1.33
28	920186	中科仪	257,221	29,528,970.80	1.31
29	301321	翰博高新	641,100	28,304,565.00	1.26
30	601211	国泰海通	1,553,582	28,275,192.40	1.26
31	300308	中际旭创	19,700	25,019,000.00	1.11
32	601816	京沪高铁	5,404,800	24,483,744.00	1.09
33	688531	日联科技	137,089	24,379,907.76	1.08
34	600346	恒力石化	1,349,300	23,896,103.00	1.06
35	600673	东阳光	703,300	23,616,814.00	1.05
36	601333	广深铁路	8,583,000	23,603,250.00	1.05
37	002080	中材科技	254,309	22,887,810.00	1.02
38	002460	赣锋锂业	342,000	22,366,800.00	0.99
39	603605	珀莱雅	351,500	21,061,880.00	0.94
40	301396	宏景科技	62,920	20,864,272.00	0.93
41	000426	兴业银锡	630,691	20,787,575.36	0.92
42	600801	华新建材	1,318,500	20,568,600.00	0.91
43	002821	凯莱英	113,167	18,333,054.00	0.81
44	300408	三环集团	109,200	18,225,480.00	0.81
45	301151	冠龙节能	930,714	15,356,781.00	0.68
46	300433	蓝思科技	282,000	15,132,120.00	0.67
47	002475	立讯精密	203,900	14,354,560.00	0.64
48	688239	航宇科技	232,597	13,916,278.51	0.62
49	688361	中科飞测	28,000	12,040,000.00	0.54
50	688200	华峰测控	21,995	11,549,574.50	0.51
51	603811	诚意药业	1,501,640	11,292,332.80	0.50
52	688521	芯原股份	30,128	11,181,705.92	0.50
53	002353	杰瑞股份	71,900	10,964,750.00	0.49
54	600549	厦门钨业	128,600	10,956,720.00	0.49
55	300274	阳光电源	66,100	10,511,222.00	0.47
56	002957	科瑞技术	176,432	9,675,530.88	0.43
57	603062	麦加芯彩	239,900	9,631,985.00	0.43
58	688008	澜起科技	30,015	9,301,648.50	0.41
59	603256	宏和科技	32,900	8,729,357.00	0.39
60	000811	冰轮环境	154,509	8,686,495.98	0.39
61	600522	中天科技	139,200	8,446,656.00	0.38
62	603659	璞泰来	266,400	7,706,952.00	0.34
63	000938	紫光股份	267,000	7,705,620.00	0.34
64	002463	沪电股份	49,500	7,563,600.00	0.34
65	600732	爱旭股份	542,200	7,509,470.00	0.33

66	300432	富临精工	371,500	7,463,435.00	0.33
67	301377	鼎泰高科	13,500	7,437,150.00	0.33
68	300857	协创数据	21,700	7,375,830.00	0.33
69	600030	中信证券	255,900	7,352,007.00	0.33
70	002126	银轮股份	146,822	7,311,735.60	0.33
71	688352	顾中科技	300,502	7,266,138.36	0.32
72	002138	顺络电子	98,600	7,207,660.00	0.32
73	600160	巨化股份	135,600	7,188,156.00	0.32
74	300502	新易盛	11,840	7,186,880.00	0.32
75	601233	桐昆股份	324,900	7,034,085.00	0.31
76	600004	白云机场	963,100	6,992,106.00	0.31
77	920125	鸿仕达	34,226	6,947,878.00	0.31
78	688519	南亚新材	18,046	6,858,201.84	0.30
79	688313	仕佳光子	36,318	6,706,118.70	0.30
80	300866	安克创新	63,600	6,646,200.00	0.30
81	002595	豪迈科技	142,100	6,621,860.00	0.29
82	601138	工业富联	89,900	6,486,285.00	0.29
83	002245	蔚蓝锂芯	340,656	6,373,673.76	0.28
84	688808	联讯仪器	2,758	6,284,692.14	0.28
85	600026	中远海能	349,200	6,264,648.00	0.28
86	000729	燕京啤酒	611,300	6,192,469.00	0.28
87	603308	应流股份	102,500	6,191,000.00	0.28
88	600690	海尔智家	297,200	6,065,852.00	0.27
89	603733	仙鹤股份	221,700	5,988,117.00	0.27
90	688775	影石创新	41,787	5,793,767.55	0.26
91	601975	招商南油	1,547,800	5,773,294.00	0.26
92	300737	科顺股份	854,591	5,614,662.87	0.25
93	002832	比音勒芬	269,600	5,564,544.00	0.25
94	000338	潍柴动力	195,900	5,338,275.00	0.24
95	002735	王子新材	326,200	5,294,226.00	0.24
96	000603	盛达资源	217,200	5,017,320.00	0.22
97	002831	裕同科技	117,700	4,185,412.00	0.19
98	688981	中芯国际	26,263	4,171,089.66	0.19
99	688127	蓝特光学	42,311	4,129,553.60	0.18
100	300976	达瑞电子	44,817	3,569,674.05	0.16
101	688403	汇成股份	87,696	3,481,531.20	0.15
102	000703	恒逸石化	180,700	2,452,099.00	0.11
103	301526	国际复材	41,900	1,955,473.00	0.09
104	002028	思源电气	9,200	1,591,600.00	0.07
105	002014	永新股份	78,400	827,904.00	0.04
106	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
107	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
108	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
109	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01

110	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
111	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
112	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
113	688818	电科蓝天	565	39,629.10	0.00
114	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
115	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
116	688712	北芯生命	792	28,448.64	0.00
117	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
118	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
119	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
120	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
121	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
122	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
123	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
124	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
125	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
126	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
127	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
128	600141	兴发集团	200	9,394.00	0.00
129	603678	火炬电子	100	8,300.00	0.00
130	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
131	001332	锡装股份	140	5,497.80	0.00
132	002364	中恒电气	100	5,380.00	0.00
133	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
134	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
135	688816	易思维	76	4,339.60	0.00
136	300652	雷迪克	100	3,351.00	0.00
137	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
138	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
139	002602	世纪华通	140	1,974.00	0.00
140	001220	世盟股份	49	1,361.22	0.00
141	603284	林平发展	38	1,325.06	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	002422	科伦药业	120,224,780.51	75.12
2	600176	中国巨石	111,885,559.00	69.91
3	603083	剑桥科技	96,202,253.03	60.11
4	002078	太阳纸业	93,775,238.00	58.60
5	688686	奥普特	91,140,214.32	56.95

6	000657	中钨高新	90,660,651.00	56.65
7	600346	恒力石化	86,563,679.00	54.09
8	300593	新雷能	85,726,451.79	53.57
9	300014	亿纬锂能	85,671,867.70	53.53
10	300433	蓝思科技	84,264,701.85	52.65
11	300666	江丰电子	83,825,008.00	52.38
12	603259	药明康德	81,988,237.00	51.23
13	688521	芯原股份	81,359,457.24	50.84
14	601872	招商轮船	81,342,715.67	50.83
15	601636	旗滨集团	79,838,414.75	49.89
16	301396	宏景科技	78,301,259.87	48.93
17	300274	阳光电源	75,617,987.20	47.25
18	300201	海伦哲	74,643,567.00	46.64
19	002837	英维克	72,907,348.58	45.56
20	002975	博杰股份	71,750,183.60	44.83
21	002353	杰瑞股份	69,580,652.52	43.48
22	002001	新和成	69,564,243.00	43.47
23	300136	信维通信	69,035,306.00	43.14
24	688519	南亚新材	67,584,368.74	42.23
25	002028	思源电气	66,889,367.00	41.80
26	688593	新相微	66,648,357.48	41.65
27	002025	航天电器	66,007,613.00	41.24
28	09988	阿里巴巴-W	65,971,432.13	41.22
29	002961	瑞达期货	65,753,745.43	41.09
30	301013	利和兴	65,072,902.06	40.66
31	600674	川投能源	64,976,441.40	40.60
32	300432	富临精工	63,916,173.30	39.94
33	002311	海大集团	63,765,830.00	39.84
34	002491	通鼎互联	63,472,673.69	39.66
35	300857	协创数据	63,465,814.75	39.66
36	300731	科创新源	63,413,434.00	39.62
37	600487	亨通光电	63,387,790.00	39.61
38	601233	桐昆股份	63,159,499.00	39.47
39	300347	泰格医药	62,803,448.38	39.24
40	603939	益丰药房	62,625,334.80	39.13
41	688307	中润光学	60,581,160.81	37.85
42	600469	风神股份	59,931,002.93	37.45
43	301511	德福科技	59,022,680.42	36.88
44	002653	海思科	58,844,417.78	36.77
45	002246	北化股份	58,798,506.00	36.74
46	300502	新易盛	58,364,363.80	36.47
47	301239	普瑞眼科	58,061,079.10	36.28
48	688720	艾森股份	57,388,268.52	35.86
49	603393	新天然气	56,777,143.70	35.48

50	002384	东山精密	56,673,751.00	35.41
51	002126	银轮股份	56,662,694.24	35.41
52	688813	泰金新能	55,916,625.30	34.94
53	603605	珀莱雅	54,343,836.80	33.96
54	688596	正帆科技	54,254,693.96	33.90
55	688008	澜起科技	54,087,556.00	33.80
56	688180	君实生物	53,783,808.39	33.61
57	688361	中科飞测	53,650,775.74	33.52
58	002957	科瑞技术	52,108,163.33	32.56
59	300759	康龙化成	52,093,731.52	32.55
60	300358	楚天科技	52,085,720.78	32.55
61	301205	联特科技	51,946,500.00	32.46
62	002821	凯莱英	51,688,269.89	32.30
63	600230	沧州大化	50,952,111.00	31.84
64	600955	维远股份	50,951,353.00	31.84
65	601869	长飞光纤	50,844,636.00	31.77
66	000703	恒逸石化	50,675,506.00	31.66
67	300308	中际旭创	50,555,989.00	31.59
68	688308	欧科亿	50,471,939.66	31.54
69	300751	迈为股份	49,893,345.96	31.18
70	688183	生益电子	48,736,012.71	30.45
71	300970	华绿生物	48,240,963.00	30.14
72	605222	起帆电缆	47,711,520.00	29.81
73	300490	华自科技	47,527,449.00	29.70
74	002594	比亚迪	47,030,793.84	29.39
75	600060	海信视像	46,571,088.00	29.10
76	603678	火炬电子	46,125,113.00	28.82
77	301526	国际复材	46,033,708.57	28.76
78	300881	盛德鑫泰	45,974,075.80	28.73
79	605117	德业股份	45,409,523.20	28.37
80	603279	景津装备	45,148,885.80	28.21
81	300483	首华燃气	44,940,746.71	28.08
82	688208	道通科技	44,874,530.25	28.04
83	002271	东方雨虹	44,519,806.00	27.82
84	600089	特变电工	43,832,002.00	27.39
85	300866	安克创新	43,761,373.60	27.34
86	603757	大元泵业	43,379,730.00	27.11
87	688559	海目星	43,358,599.22	27.09
88	600893	航发动力	42,901,122.00	26.81
89	600110	诺德股份	42,563,389.00	26.60
90	600522	中天科技	42,350,729.00	26.46
91	000962	东方钨业	41,328,686.50	25.82
92	00981	中芯国际	30,000,403.74	18.75
92	688981	中芯国际	11,259,449.78	7.04

93	002637	赞宇科技	41,127,528.00	25.70
94	000021	深科技	39,911,628.00	24.94
95	603256	宏和科技	39,684,966.00	24.80
96	688719	爱科赛博	39,640,195.98	24.77
97	688020	方邦股份	39,640,176.02	24.77
98	603195	公牛集团	39,034,747.51	24.39
99	300943	春晖智控	38,874,222.00	24.29
100	300726	宏达电子	38,746,451.00	24.21
101	002150	正泰电源	38,731,860.00	24.20
102	300617	安靠智电	37,949,972.00	23.71
103	300285	国瓷材料	37,621,295.50	23.51
104	601838	成都银行	37,582,238.91	23.48
105	603026	石大胜华	37,267,992.00	23.29
106	002469	三维化学	37,125,613.50	23.20
107	002484	江海股份	36,693,929.00	22.93
108	688480	赛恩斯	36,686,550.01	22.92
109	002756	永兴材料	36,563,659.00	22.85
110	600378	昊华科技	36,557,858.00	22.84
111	688787	海天瑞声	36,402,267.82	22.75
112	002971	和远气体	36,338,101.00	22.71
113	603268	松发股份	36,101,849.00	22.56
114	300394	天孚通信	35,960,277.00	22.47
115	601126	四方股份	35,393,125.00	22.12
116	002245	蔚蓝锂芯	35,307,105.72	22.06
117	002706	良信股份	35,260,808.00	22.03
118	300398	飞凯材料	35,260,627.56	22.03
119	603806	福斯特	35,259,794.32	22.03
120	920179	凯德石英	35,007,105.57	21.87
121	002396	星网锐捷	34,963,708.72	21.85
122	688195	腾景科技	34,676,126.90	21.67
123	688239	航宇科技	34,159,166.05	21.34
124	09863	零跑汽车	33,919,426.87	21.19
125	603733	仙鹤股份	33,852,971.03	21.15
126	002916	深南电路	33,822,275.00	21.13
127	000719	中原传媒	33,821,514.88	21.13
128	002832	比音勒芬	33,804,347.00	21.12
129	301018	申菱环境	33,685,556.60	21.05
130	688258	卓易信息	33,607,559.84	21.00
131	605598	上海港湾	33,209,806.00	20.75
132	002600	领益智造	33,177,761.00	20.73
133	600309	万华化学	33,155,359.43	20.72
134	01548	金斯瑞生物科技	33,107,846.36	20.69
135	688796	百奥赛图	32,833,346.42	20.52
136	002240	盛新锂能	32,715,921.08	20.44

137	002643	万润股份	32,607,705.00	20.37
138	688002	睿创微纳	32,513,835.53	20.32
139	300737	科顺股份	32,255,033.00	20.15
140	688313	仕佳光子	32,230,358.22	20.14
141	301362	民爆光电	32,116,965.00	20.07
142	688766	普冉股份	32,097,091.96	20.06
143	301305	朗坤科技	32,017,605.37	20.01
144	300900	广联航空	32,016,180.25	20.01
145	603353	和顺石油	32,015,497.00	20.00
146	603659	璞泰来	32,009,638.00	20.00
147	002714	牧原股份	31,987,357.00	19.99
148	600988	赤峰黄金	31,774,112.00	19.85
149	300438	鹏辉能源	31,769,885.00	19.85
150	688818	电科蓝天	31,711,444.15	19.81
151	920522	纳科诺尔	31,685,510.64	19.80
152	688552	航天南湖	31,685,500.76	19.80
153	600316	洪都航空	31,682,287.00	19.80
154	688409	富创精密	31,564,341.32	19.72
155	600549	厦门钨业	31,416,632.00	19.63
156	601211	国泰海通	31,355,572.60	19.59
157	001400	江顺科技	31,304,036.00	19.56
158	603618	杭电股份	30,887,560.14	19.30
159	301312	智立方	30,769,798.20	19.23
160	300131	英唐智控	30,470,051.08	19.04
161	300757	罗博特科	30,455,972.22	19.03
162	002292	奥飞娱乐	30,455,311.00	19.03
163	301217	铜冠铜箔	30,402,467.90	19.00
164	600482	中国动力	30,342,037.00	18.96
165	02208	金风科技	30,325,602.71	18.95
166	01347	华虹宏力	30,010,126.84	18.75
167	300191	潜能恒信	29,588,948.00	18.49
168	000683	博源化工	29,337,215.00	18.33
169	600938	中国海油	29,325,879.00	18.32
170	002518	科士达	29,282,189.00	18.30
171	002541	鸿路钢构	29,118,509.00	18.19
172	603997	继峰股份	28,793,158.00	17.99
173	001979	招商蛇口	28,684,805.00	17.92
174	002532	天山铝业	28,218,048.00	17.63
175	000807	云铝股份	28,217,535.00	17.63
176	002176	江特电机	28,039,061.00	17.52
177	603979	金诚信	27,914,330.00	17.44
178	603619	中曼石油	27,907,020.85	17.44
179	002460	赣锋锂业	27,743,335.00	17.34
180	688416	恒烁股份	27,702,218.90	17.31

181	600989	宝丰能源	27,690,876.00	17.30
182	300196	长海股份	27,640,243.20	17.27
183	000404	长虹华意	27,510,963.25	17.19
184	688301	奕瑞科技	27,510,896.95	17.19
185	002203	海亮股份	27,509,404.00	17.19
186	600105	永鼎股份	27,506,504.00	17.19
187	000423	东阿阿胶	27,505,687.00	17.19
188	603345	安井食品	27,504,430.12	17.19
189	002371	北方华创	27,446,426.16	17.15
190	920181	赛英电子	27,179,164.67	16.98
191	920178	锐翔智能	27,156,304.19	16.97
192	688676	金盘科技	27,107,735.48	16.94
193	300001	特锐德	27,107,065.00	16.94
194	688585	上纬新材	26,928,251.42	16.83
195	300750	宁德时代	26,924,351.00	16.82
196	603856	东宏股份	26,730,365.10	16.70
197	688610	埃科光电	26,719,877.50	16.70
198	600177	雅戈尔	26,422,599.00	16.51
199	300855	图南股份	26,190,521.00	16.37
200	688729	屹唐股份	26,164,757.51	16.35
201	600686	金龙汽车	26,161,791.00	16.35
202	002980	华盛昌	26,154,731.00	16.34
203	300835	龙磁科技	26,149,241.00	16.34
204	002317	众生药业	26,023,071.00	16.26
205	603766	隆鑫通用	26,021,074.00	16.26
206	300832	新产业	26,000,756.00	16.25
207	002871	伟隆股份	25,997,466.00	16.24
208	603078	江化微	25,890,084.11	16.18
209	600980	北矿科技	25,785,135.00	16.11
210	601333	广深铁路	25,688,105.00	16.05
211	601816	京沪高铁	25,688,100.00	16.05
212	000426	兴业银锡	25,686,578.34	16.05
213	002938	鹏鼎控股	25,622,742.00	16.01
214	688131	皓元医药	25,619,028.17	16.01
215	002192	融捷股份	25,379,725.84	15.86
216	301358	湖南裕能	25,378,949.00	15.86
217	301321	翰博高新	25,171,975.00	15.73
218	603011	合锻智能	25,165,123.00	15.72
219	688531	日联科技	25,163,006.86	15.72
220	002080	中材科技	25,143,562.13	15.71
221	603701	德宏股份	25,062,535.90	15.66
222	688548	广钢气体	25,062,240.62	15.66
223	688758	赛分科技	24,992,838.13	15.62
224	301333	诺思格	24,990,234.00	15.62

225	601318	中国平安	24,989,576.00	15.61
226	600498	烽火通信	24,965,861.00	15.60
227	300207	欣旺达	24,847,349.00	15.53
228	300476	胜宏科技	24,819,958.00	15.51
229	601899	紫金矿业	24,578,072.00	15.36
230	688079	美迪凯	24,564,755.06	15.35
231	688488	艾迪药业	24,551,666.41	15.34
232	002033	丽江股份	24,469,108.16	15.29
233	600803	新奥股份	24,438,633.00	15.27
234	600801	华新建材	24,372,888.00	15.23
235	000960	锡业股份	24,297,336.00	15.18
236	300475	香农芯创	24,280,063.00	15.17
237	603380	易德龙	24,238,384.00	15.15
238	603338	浙江鼎力	24,229,918.00	15.14
239	920125	鸿仕达	24,146,075.80	15.09
240	002457	青龙管业	23,771,621.00	14.85
241	600690	海尔智家	23,640,036.00	14.77
242	605599	菜百股份	23,474,094.68	14.67
243	000672	上峰材料	23,422,389.60	14.64
244	605007	五洲特纸	23,391,499.40	14.62
245	920186	中科仪	23,309,544.51	14.56
246	601377	兴业证券	23,251,254.79	14.53
247	603299	苏盐井神	23,025,462.01	14.39
248	300498	温氏股份	22,869,711.00	14.29
249	600398	海澜之家	22,844,749.00	14.27
250	600673	东阳光	22,825,108.00	14.26
251	688283	坤恒顺维	22,812,004.77	14.25
252	688617	惠泰医疗	22,797,517.25	14.25
253	688041	海光信息	22,725,450.72	14.20
254	603198	迎驾贡酒	22,659,272.00	14.16
255	600183	生益科技	22,431,661.32	14.02
256	02367	巨子生物	22,378,525.76	13.98
257	300408	三环集团	21,816,667.00	13.63
258	603127	昭衍新药	21,657,771.00	13.53
259	002851	麦格米特	21,163,838.00	13.22
260	600111	北方稀土	21,144,900.00	13.21
261	601198	东兴证券	20,900,227.00	13.06
262	688516	奥特维	20,783,976.32	12.99
263	688376	美埃科技	20,389,120.71	12.74
264	920368	连城数控	20,304,631.99	12.69
265	603590	康辰药业	19,582,594.00	12.24
266	600418	江淮汽车	19,160,552.85	11.97
267	600583	海油工程	19,092,767.00	11.93
268	000065	北方国际	19,092,289.50	11.93

269	601615	明阳智能	18,913,072.72	11.82
270	301151	冠龙节能	18,847,900.40	11.78
271	301363	美好医疗	18,472,056.00	11.54
272	002595	豪迈科技	17,762,451.90	11.10
273	688553	汇宇制药	17,652,956.86	11.03
274	300620	光库科技	17,376,263.00	10.86
275	600863	华能蒙电	17,107,417.00	10.69
276	600603	广汇物流	16,967,138.00	10.60
277	002159	三特索道	16,609,882.00	10.38
278	688222	成都先导	16,487,011.20	10.30
279	601633	长城汽车	16,462,675.00	10.29
280	002818	富森美	16,420,289.93	10.26
281	002483	润邦股份	16,351,093.80	10.22
282	002068	黑猫股份	16,324,230.00	10.20
283	000568	泸州老窖	16,259,318.00	10.16
284	600809	山西汾酒	16,257,390.00	10.16
285	002648	卫星化学	16,180,425.00	10.11
286	300775	三角防务	16,132,442.00	10.08
287	600909	华安证券	16,009,308.00	10.00
288	300480	光力科技	16,006,758.00	10.00
289	002008	大族激光	15,899,681.00	9.93
290	300418	昆仑万维	15,695,965.00	9.81
291	688385	复旦微电	15,626,334.48	9.76
292	600862	中航高科	15,621,128.00	9.76
293	301548	崇德科技	15,538,950.16	9.71
294	688390	固德威	15,448,794.79	9.65
295	000603	盛达资源	15,389,920.00	9.62
296	601919	中远海控	15,188,446.00	9.49
297	600415	小商品城	15,179,018.00	9.48
298	600875	东方电气	15,176,981.00	9.48
299	000039	中集集团	15,005,637.40	9.38
300	603288	海天味业	14,960,202.80	9.35
301	605060	联德股份	14,888,838.00	9.30
302	600188	兖矿能源	14,839,935.00	9.27
303	688726	拉普拉斯	14,801,305.66	9.25
304	600030	中信证券	14,794,502.00	9.24
305	002138	顺络电子	14,793,747.00	9.24
306	01093	石药集团	14,503,537.77	9.06
307	000338	潍柴动力	14,330,924.00	8.95
308	601138	工业富联	14,191,390.00	8.87
309	000651	格力电器	14,089,413.00	8.80
310	603129	春风动力	14,068,905.42	8.79
311	002475	立讯精密	13,955,981.00	8.72
312	002092	中泰化学	13,902,835.00	8.69

313	300976	达瑞电子	13,859,693.91	8.66
314	601866	中远海发	13,804,569.00	8.63
315	002658	雪迪龙	13,804,124.00	8.63
316	603269	海鸥股份	13,755,544.00	8.60
317	600551	时代出版	13,705,298.85	8.56
318	300482	万孚生物	13,485,174.96	8.43
319	688206	概伦电子	13,427,970.73	8.39
320	002463	沪电股份	13,405,752.70	8.38
321	600868	梅雁吉祥	13,323,857.00	8.33
322	300677	英科医疗	13,311,938.00	8.32
323	688311	盟升电子	12,947,000.56	8.09
324	300693	盛弘股份	12,922,023.00	8.07
325	920045	衡东光	12,823,534.35	8.01
326	920394	民士达	12,789,492.19	7.99
327	002667	*ST 威领	12,503,127.00	7.81
328	600429	三元股份	12,424,061.40	7.76
329	601828	美凯龙	12,423,953.00	7.76
330	300337	银邦股份	12,363,183.00	7.73
331	600323	瀚蓝环境	12,218,237.00	7.63
332	603093	南华期货	12,118,465.00	7.57
333	002379	宏桥控股	11,958,551.00	7.47
334	000792	盐湖股份	11,865,126.00	7.41
335	603811	诚意药业	11,829,881.00	7.39
336	688377	迪威尔	11,515,258.08	7.20
337	600841	动力新科	11,381,535.00	7.11
338	600054	黄山旅游	11,381,198.00	7.11
339	002455	百川股份	11,276,777.00	7.05
340	301446	福事特	11,274,431.00	7.04
341	001360	南矿集团	11,274,209.00	7.04
342	001288	运机集团	11,273,233.00	7.04
343	301202	朗威股份	11,273,133.00	7.04
344	600273	嘉化能源	11,079,936.00	6.92
345	000912	泸天化	11,061,823.00	6.91
346	300277	汽轮科技	11,061,754.52	6.91
347	300139	晓程科技	11,055,367.00	6.91
348	000506	招金黄金	10,983,877.00	6.86
349	002985	北摩高科	10,953,615.00	6.84
350	603062	麦加芯彩	10,261,007.00	6.41
351	300893	松原安全	9,936,861.04	6.21
352	000582	北部湾港	9,693,612.00	6.06
353	601969	海南矿业	9,434,148.00	5.89
354	300818	耐普矿机	9,259,974.00	5.79
355	601689	拓普集团	9,082,129.00	5.67
356	002895	川恒股份	8,832,004.00	5.52

357	603067	振华股份	8,130,230.00	5.08
358	002508	老板电器	8,129,820.00	5.08
359	300124	汇川技术	8,117,820.50	5.07
360	600519	贵州茅台	8,098,425.00	5.06
361	300548	长芯博创	7,980,507.00	4.99
362	688256	寒武纪	7,638,505.28	4.77
363	001233	海安集团	7,626,974.00	4.77
364	301486	致尚科技	7,621,836.00	4.76
365	300972	万辰集团	7,593,429.00	4.74
366	002056	横店东磁	7,475,297.00	4.67
367	688392	骄成超声	7,475,260.08	4.67
368	002179	中航光电	7,474,188.00	4.67
369	300979	华利集团	7,453,163.00	4.66
370	600233	圆通速递	7,394,540.00	4.62
371	600754	锦江酒店	7,365,189.00	4.60
372	601975	招商南油	7,357,752.00	4.60
373	600026	中远海能	7,357,035.00	4.60
374	688777	中控技术	7,249,665.15	4.53
375	601058	赛轮轮胎	7,201,842.00	4.50
376	688048	长光华芯	7,199,051.01	4.50
377	000811	冰轮环境	7,165,686.94	4.48
378	000550	江铃汽车	7,164,940.16	4.48
379	600066	宇通客车	7,164,227.00	4.48
380	300171	东富龙	7,055,195.30	4.41
381	600584	长电科技	7,049,777.00	4.41
382	603308	应流股份	7,048,207.00	4.40
383	000938	紫光股份	7,046,935.00	4.40
384	000729	燕京啤酒	7,046,417.00	4.40
385	600004	白云机场	7,031,036.00	4.39
386	600160	巨化股份	7,022,201.00	4.39
387	603889	新澳股份	6,981,945.00	4.36
388	688615	合合信息	6,926,411.28	4.33
389	688200	华峰测控	6,921,871.74	4.33
390	600732	爱旭股份	6,823,773.00	4.26
391	601339	百隆东方	6,673,772.00	4.17
392	301377	鼎泰高科	6,615,530.00	4.13
393	688627	精智达	6,606,767.89	4.13
394	688775	影石创新	6,605,324.70	4.13
395	002741	光华科技	6,513,974.00	4.07
396	688808	联讯仪器	6,434,645.64	4.02
397	300499	高澜股份	6,405,702.00	4.00
398	300584	海辰药业	6,313,381.00	3.94
399	002735	王子新材	6,305,177.00	3.94
400	603112	华翔股份	6,240,853.00	3.90

401	688352	颀中科技	6,220,298.28	3.89
402	688087	英科再生	6,172,971.87	3.86
403	002272	川润股份	6,092,949.00	3.81
404	300331	苏大维格	6,040,945.00	3.77
405	000036	华联控股	5,942,863.00	3.71
406	601880	辽港股份	5,891,520.00	3.68
407	600623	华谊集团	5,528,163.00	3.45
408	603238	诺邦股份	5,395,962.00	3.37
409	688150	莱特光电	5,069,538.42	3.17
410	603236	移远通信	5,053,928.00	3.16
411	688091	上海谊众	4,894,096.73	3.06
412	688293	奥浦迈	4,662,916.77	2.91
413	603124	江南新材	4,222,754.00	2.64
414	920640	富士达	4,100,377.02	2.56
415	603061	金海通	4,002,255.00	2.50
416	603861	白云电器	3,988,331.00	2.49
417	601886	江河集团	3,924,474.00	2.45
418	000419	通程控股	3,903,259.00	2.44
419	688046	药康生物	3,883,820.20	2.43
420	688312	燕麦科技	3,810,843.82	2.38
421	301629	矽电股份	3,718,279.00	2.32
422	300170	汉得信息	3,710,686.00	2.32
423	688119	中钢洛耐	3,689,586.65	2.31
424	000510	新金路	3,682,181.00	2.30
425	600998	九州通	3,672,083.00	2.29
426	688403	汇成股份	3,628,457.02	2.27
427	688331	荣昌生物	3,547,824.91	2.22
428	301216	万凯新材	3,525,994.00	2.20
429	688127	蓝特光学	3,411,951.45	2.13
430	688248	南网科技	3,398,483.18	2.12
431	301662	宏工科技	3,397,898.00	2.12
432	002831	裕同科技	3,383,250.99	2.11
433	600299	安迪苏	3,254,775.00	2.03
434	688235	百济神州	3,248,411.01	2.03

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	603083	剑桥科技	113,097,021.50	70.67
2	301396	宏景科技	112,688,768.23	70.41
3	301511	德福科技	109,809,115.93	68.61

4	688813	泰金新能	101,002,339.08	63.11
5	600176	中国巨石	95,977,855.65	59.97
6	300433	蓝思科技	92,881,929.00	58.04
7	002078	太阳纸业	88,378,106.00	55.22
8	002422	科伦药业	86,990,745.00	54.36
9	600487	亨通光电	85,563,310.68	53.46
10	301013	利和兴	84,374,991.09	52.72
11	688519	南亚新材	79,128,797.87	49.44
12	300274	阳光电源	78,593,502.00	49.11
13	688521	芯原股份	73,530,646.94	45.95
14	300593	新雷能	73,191,980.50	45.73
15	603678	火炬电子	73,125,671.00	45.69
16	688596	正帆科技	71,683,242.20	44.79
17	688008	澜起科技	71,109,310.91	44.43
18	300432	富临精工	70,176,615.81	43.85
19	002353	杰瑞股份	69,925,221.08	43.69
20	601869	长飞光纤	66,383,694.00	41.48
21	002653	海思科	66,381,733.48	41.48
22	300731	科创新源	66,163,943.60	41.34
23	300857	协创数据	65,937,090.00	41.20
24	688308	欧科亿	65,806,340.91	41.12
25	688361	中科飞测	64,781,563.65	40.48
26	600674	川投能源	64,449,215.28	40.27
27	300347	泰格医药	63,368,675.00	39.60
28	09988	阿里巴巴-W	63,270,489.15	39.53
29	002311	海大集团	61,982,297.00	38.73
30	002246	北化股份	61,948,860.81	38.71
31	002491	通鼎互联	61,694,001.79	38.55
32	688720	艾森股份	60,157,655.85	37.59
33	300666	江丰电子	60,116,536.20	37.56
34	603939	益丰药房	58,982,634.92	36.86
35	301526	国际复材	58,177,536.04	36.35
36	002126	银轮股份	57,911,335.00	36.19
37	002028	思源电气	57,784,542.00	36.11
38	300502	新易盛	57,085,959.60	35.67
39	301239	普瑞眼科	57,071,459.30	35.66
40	000657	中钨高新	56,837,893.10	35.52
41	600346	恒力石化	56,739,036.00	35.45
42	600469	风神股份	56,493,045.05	35.30
43	688020	方邦股份	55,827,028.20	34.88
44	002961	瑞达期货	55,532,278.76	34.70
45	601233	桐昆股份	53,812,619.00	33.62
46	301205	联特科技	53,802,295.00	33.62
47	688307	中润光学	53,451,685.75	33.40

48	605222	起帆电缆	52,512,927.00	32.81
49	601872	招商轮船	51,789,556.00	32.36
50	688593	新相微	51,684,957.81	32.30
51	301217	铜冠铜箔	51,155,269.80	31.96
52	600955	维远股份	51,078,533.00	31.92
53	600230	沧州大化	51,052,314.08	31.90
54	300394	天孚通信	49,895,595.40	31.18
55	300751	迈为股份	49,733,431.76	31.08
56	000703	恒逸石化	49,482,930.92	30.92
57	300201	海伦哲	49,025,163.00	30.63
58	300358	楚天科技	47,578,856.38	29.73
59	601126	四方股份	47,567,582.00	29.72
60	002594	比亚迪	47,207,374.00	29.50
61	605117	德业股份	46,459,328.14	29.03
62	002971	和远气体	46,169,909.00	28.85
63	688180	君实生物	46,121,689.13	28.82
64	603393	新天然气	45,968,750.80	28.72
65	600522	中天科技	45,778,058.86	28.60
66	300490	华自科技	45,732,194.00	28.58
67	600110	诺德股份	45,691,339.00	28.55
68	002271	东方雨虹	45,378,817.00	28.35
69	300970	华绿生物	44,888,259.00	28.05
70	688719	爱科赛博	44,776,735.76	27.98
71	00981	中芯国际	38,024,708.28	23.76
71	688981	中芯国际	6,709,785.28	4.19
72	603026	石大胜华	44,412,033.79	27.75
73	300191	潜能恒信	44,124,472.00	27.57
74	688208	道通科技	43,343,043.74	27.08
75	301362	民爆光电	43,205,715.00	27.00
76	600089	特变电工	42,833,797.04	26.76
77	002756	永兴材料	42,702,515.00	26.68
78	603256	宏和科技	42,168,543.00	26.35
79	300881	盛德鑫泰	41,946,679.00	26.21
80	688002	睿创微纳	41,493,529.45	25.93
81	688559	海目星	40,955,893.07	25.59
82	000021	深科技	40,941,097.00	25.58
83	002001	新和成	40,570,830.00	25.35
84	002637	赞宇科技	40,484,470.00	25.30
85	300438	鹏辉能源	40,402,859.18	25.25
86	300398	飞凯材料	40,151,567.48	25.09
87	002384	东山精密	39,927,800.90	24.95
88	300726	宏达电子	39,813,749.65	24.88
89	688818	电科蓝天	39,658,605.09	24.78
90	300483	首华燃气	39,584,047.00	24.73

91	601636	旗滨集团	39,462,438.00	24.66
92	603279	景津装备	38,822,609.00	24.26
93	002025	航天电器	38,765,350.60	24.22
94	600378	昊华科技	38,550,910.00	24.09
95	600893	航发动力	38,471,334.74	24.04
96	300136	信维通信	38,418,248.64	24.01
97	000962	东方钨业	38,411,458.00	24.00
98	688787	海天瑞声	38,236,534.40	23.89
99	601838	成都银行	37,963,314.86	23.72
100	002821	凯莱英	37,598,815.38	23.49
101	01347	华虹宏力	36,849,134.92	23.03
102	300131	英唐智控	36,840,494.24	23.02
103	000719	中原传媒	36,642,479.95	22.90
104	002600	领益智造	36,618,389.79	22.88
105	603195	公牛集团	36,453,843.83	22.78
106	002957	科瑞技术	36,101,424.00	22.56
107	603757	大元泵业	36,008,935.00	22.50
108	002396	星网锐捷	35,932,391.76	22.45
109	002245	蔚蓝锂芯	35,850,972.00	22.40
110	300617	安靠智电	35,751,119.90	22.34
111	002240	盛新锂能	35,641,205.00	22.27
112	002150	正泰电源	35,257,492.92	22.03
113	688313	仕佳光子	35,145,403.91	21.96
114	300866	安克创新	34,903,277.50	21.81
115	002706	良信股份	34,883,733.00	21.80
116	603259	药明康德	34,591,559.00	21.61
117	600309	万华化学	34,245,690.00	21.40
118	688195	腾景科技	34,170,123.99	21.35
119	603618	杭电股份	34,122,916.96	21.32
120	001400	江顺科技	34,036,878.00	21.27
121	688258	卓易信息	33,740,081.25	21.08
122	002916	深南电路	33,321,582.24	20.82
123	002469	三维化学	32,960,861.50	20.60
124	920522	纳科诺尔	32,378,337.00	20.23
125	920179	凯德石英	32,115,052.55	20.07
126	688480	赛恩斯	32,089,426.74	20.05
127	02208	金风科技	31,872,741.02	19.92
128	603268	松发股份	31,721,820.00	19.82
129	603619	中曼石油	31,601,893.56	19.75
130	688766	普冉股份	31,330,474.24	19.58
131	688416	恒烁股份	31,097,433.75	19.43
132	300308	中际旭创	31,015,348.00	19.38
133	300757	罗博特科	30,985,738.69	19.36
134	603806	福斯特	30,748,463.20	19.21

135	002371	北方华创	30,657,865.00	19.16
136	600482	中国动力	30,648,044.00	19.15
137	09863	零跑汽车	30,169,247.08	18.85
138	600183	生益科技	29,989,122.00	18.74
139	002714	牧原股份	29,957,377.00	18.72
140	002980	华盛昌	29,822,595.00	18.63
141	688585	上纬新材	29,718,291.93	18.57
142	002837	英维克	29,686,541.97	18.55
143	300196	长海股份	29,577,077.48	18.48
144	301333	诺思格	29,411,866.18	18.38
145	000683	博源化工	29,330,272.72	18.33
146	920181	赛英电子	29,293,296.43	18.30
147	300737	科顺股份	29,050,929.49	18.15
148	002832	比音勒芬	28,891,771.00	18.05
149	603979	金诚信	28,774,226.88	17.98
150	000807	云铝股份	28,701,123.90	17.93
151	605599	菜百股份	28,601,209.59	17.87
152	000672	上峰材料	28,364,375.40	17.72
153	603011	合锻智能	28,169,392.33	17.60
154	600316	洪都航空	28,169,043.00	17.60
155	603605	珀莱雅	28,136,871.60	17.58
156	600988	赤峰黄金	28,107,109.00	17.56
157	300001	特锐德	28,096,581.00	17.56
158	301312	智立方	28,077,605.56	17.54
159	688301	奕瑞科技	27,979,626.48	17.48
160	301358	湖南裕能	27,961,056.00	17.47
161	688686	奥普特	27,864,191.87	17.41
162	688796	百奥赛图	27,377,975.54	17.11
163	600989	宝丰能源	27,327,411.00	17.08
164	01548	金斯瑞生物科技	27,314,326.38	17.07
165	002532	天山铝业	27,273,947.00	17.04
166	002518	科士达	27,050,182.02	16.90
167	603338	浙江鼎力	27,048,499.00	16.90
168	002317	众生药业	27,019,493.00	16.88
169	301305	朗坤科技	26,953,733.60	16.84
170	601318	中国平安	26,872,138.60	16.79
171	002541	鸿路钢构	26,834,613.00	16.77
172	300835	龙磁科技	26,772,114.40	16.73
173	300832	新产业	26,621,531.02	16.63
174	603078	江化微	26,618,160.42	16.63
175	600105	永鼎股份	26,579,008.00	16.61
176	688676	金盘科技	26,444,795.52	16.52
177	688729	屹唐股份	26,293,446.22	16.43
178	603198	迎驾贡酒	26,246,855.00	16.40

179	300900	广联航空	26,134,967.86	16.33
180	603733	仙鹤股份	26,017,873.00	16.26
181	688758	赛分科技	26,013,877.54	16.25
182	002938	鹏鼎控股	25,822,323.00	16.14
183	600177	雅戈尔	25,792,599.11	16.12
184	002203	海亮股份	25,740,421.00	16.08
185	300759	康龙化成	25,696,894.00	16.06
186	002292	奥飞娱乐	25,449,533.00	15.90
187	603353	和顺石油	25,322,587.50	15.82
188	002851	麦格米特	25,292,995.00	15.80
189	001979	招商蛇口	25,162,969.00	15.72
190	300476	胜宏科技	25,125,196.00	15.70
191	300750	宁德时代	25,093,636.00	15.68
192	603997	继峰股份	24,996,392.00	15.62
193	688552	航天南湖	24,804,342.55	15.50
194	603701	德宏股份	24,754,352.00	15.47
195	688079	美迪凯	24,662,503.52	15.41
196	688610	埃科光电	24,507,113.53	15.31
197	600938	中国海油	24,374,643.00	15.23
198	688131	皓元医药	24,351,508.65	15.22
199	000423	东阿阿胶	24,350,570.76	15.22
200	920368	连城数控	24,323,421.27	15.20
201	000960	锡业股份	24,228,819.00	15.14
202	601899	紫金矿业	24,203,201.00	15.12
203	688488	艾迪药业	24,196,974.58	15.12
204	603659	璞泰来	24,146,798.35	15.09
205	002176	江特电机	23,976,764.00	14.98
206	688376	美埃科技	23,970,619.59	14.98
207	300498	温氏股份	23,903,121.00	14.94
208	605598	上海港湾	23,890,379.00	14.93
209	002192	融捷股份	23,821,568.00	14.88
210	603345	安井食品	23,781,247.00	14.86
211	002871	伟隆股份	23,602,017.00	14.75
212	002033	丽江股份	23,520,740.30	14.70
213	603127	昭衍新药	23,463,450.04	14.66
214	603856	东宏股份	23,406,049.20	14.63
215	000404	长虹华意	23,292,294.07	14.55
216	600498	烽火通信	23,248,157.00	14.53
217	605007	五洲特纸	23,226,737.00	14.51
218	600686	金龙汽车	23,223,397.00	14.51
219	688548	广钢气体	23,171,722.04	14.48
220	600398	海澜之家	23,020,803.10	14.38
221	601198	东兴证券	22,642,203.00	14.15
222	300014	亿纬锂能	22,629,706.76	14.14

223	603766	隆鑫通用	22,589,599.00	14.12
224	688041	海光信息	22,534,088.67	14.08
225	600803	新奥股份	22,526,110.50	14.08
226	600980	北矿科技	22,303,249.00	13.94
227	300207	欣旺达	22,302,563.34	13.94
228	000039	中集集团	21,862,565.30	13.66
229	603299	苏盐井神	21,764,681.00	13.60
230	601377	兴业证券	21,474,593.00	13.42
231	000065	北方国际	21,472,884.00	13.42
232	300855	图南股份	21,063,544.63	13.16
233	688239	航宇科技	20,995,622.26	13.12
234	002457	青龙管业	20,950,834.00	13.09
235	688283	坤恒顺维	20,940,547.52	13.08
236	688617	惠泰医疗	20,881,752.85	13.05
237	002008	大族激光	20,486,688.00	12.80
238	688516	奥特维	20,374,141.30	12.73
239	02367	巨子生物	20,265,354.16	12.66
240	605060	联德股份	19,864,911.00	12.41
241	600418	江淮汽车	19,021,701.37	11.89
242	601615	明阳智能	18,358,774.08	11.47
243	600549	厦门钨业	18,005,755.00	11.25
244	301363	美好医疗	17,898,741.00	11.18
245	920125	鸿仕达	17,751,292.69	11.09
246	002648	卫星化学	17,591,243.08	10.99
247	688553	汇宇制药	17,477,874.06	10.92
248	600603	广汇物流	17,077,797.07	10.67
249	600583	海油工程	17,021,528.00	10.64
250	601633	长城汽车	17,018,127.32	10.63
251	002092	中泰化学	16,914,681.00	10.57
252	600690	海尔智家	16,573,481.96	10.36
253	603590	康辰药业	16,432,077.00	10.27
254	688385	复旦微电	16,303,532.02	10.19
255	300480	光力科技	16,000,104.00	10.00
256	600111	北方稀土	15,934,479.00	9.96
257	688390	固德威	15,845,722.81	9.90
258	002159	三特索道	15,822,039.00	9.89
259	600863	华能蒙电	15,677,638.00	9.80
260	600862	中航高科	15,606,014.00	9.75
261	301548	崇德科技	15,441,682.50	9.65
262	002818	富森美	15,159,195.37	9.47
263	300976	达瑞电子	15,058,785.68	9.41
264	300620	光库科技	14,917,858.00	9.32
265	002379	宏桥控股	14,858,208.00	9.28
266	688222	成都先导	14,834,044.03	9.27

267	300277	汽轮科技	14,723,087.28	9.20
268	601919	中远海控	14,708,575.17	9.19
269	002068	黑猫股份	14,689,091.00	9.18
270	300775	三角防务	14,571,033.00	9.10
271	603129	春风动力	14,559,253.00	9.10
272	601866	中远海发	14,536,419.00	9.08
273	600909	华安证券	14,369,154.00	8.98
274	01093	石药集团	14,332,765.67	8.96
275	600809	山西汾酒	14,247,530.80	8.90
276	002483	润邦股份	14,147,238.20	8.84
277	000568	泸州老窖	13,919,217.88	8.70
278	603288	海天味业	13,773,719.30	8.61
279	600551	时代出版	13,656,477.50	8.53
280	300418	昆仑万维	13,639,889.00	8.52
281	000651	格力电器	13,557,170.82	8.47
282	688311	盟升电子	13,530,097.82	8.45
283	600188	兖矿能源	13,481,452.50	8.42
284	920178	锐翔智能	13,354,910.91	8.34
285	603269	海鸥股份	13,289,372.00	8.30
286	000603	盛达资源	13,110,535.00	8.19
287	002455	百川股份	12,812,119.30	8.01
288	688726	拉普拉斯	12,774,532.30	7.98
289	920045	衡东光	12,767,198.31	7.98
290	600875	东方电气	12,765,384.00	7.98
291	688377	迪威尔	12,675,671.83	7.92
292	300482	万孚生物	12,654,704.00	7.91
293	002658	雪迪龙	12,586,548.00	7.86
294	000506	招金黄金	12,536,682.00	7.83
295	600429	三元股份	12,533,269.80	7.83
296	688206	概伦电子	12,357,041.16	7.72
297	600415	小商品城	12,238,793.00	7.65
298	000912	泸天化	12,053,740.00	7.53
299	920394	民士达	12,028,305.67	7.52
300	600273	嘉化能源	11,999,363.00	7.50
301	600323	瀚蓝环境	11,952,260.00	7.47
302	300677	英科医疗	11,599,072.40	7.25
303	300337	银邦股份	11,525,075.28	7.20
304	600841	动力新科	11,444,290.00	7.15
305	300972	万辰集团	11,413,285.00	7.13
306	000792	盐湖股份	11,352,070.00	7.09
307	601828	美凯龙	11,333,116.00	7.08
308	000582	北部湾港	11,125,237.00	6.95
309	600868	梅雁吉祥	10,813,123.00	6.76
310	300139	晓程科技	10,623,269.00	6.64

311	603093	南华期货	10,577,895.00	6.61
312	300693	盛弘股份	10,261,103.00	6.41
313	301202	朗威股份	10,201,861.00	6.37
314	002985	北摩高科	10,124,486.00	6.33
315	001360	南矿集团	10,034,466.00	6.27
316	301446	福事特	10,024,227.00	6.26
317	600054	黄山旅游	10,013,913.50	6.26
318	002667	*ST 威领	9,721,960.00	6.07
319	001288	运机集团	9,548,753.00	5.97
320	002595	豪迈科技	9,453,872.75	5.91
321	601969	海南矿业	9,435,119.00	5.90
322	002508	老板电器	9,168,821.00	5.73
323	601689	拓普集团	9,143,946.00	5.71
324	002895	川恒股份	9,058,148.00	5.66
325	002138	顺络电子	8,933,324.00	5.58
326	300893	松原安全	8,814,446.40	5.51
327	603067	振华股份	8,808,489.10	5.50
328	300548	长芯博创	8,731,385.00	5.46
329	002056	横店东磁	8,460,184.00	5.29
330	688777	中控技术	8,441,851.17	5.27
331	688392	骄成超声	8,379,095.48	5.24
332	002179	中航光电	8,310,987.74	5.19
333	688627	精智达	8,138,393.42	5.09
334	688048	长光华芯	8,025,978.69	5.02
335	600030	中信证券	7,983,441.00	4.99
336	300818	耐普矿机	7,976,583.00	4.98
337	688362	甬矽电子	7,931,263.70	4.96
338	001233	海安集团	7,860,270.00	4.91
339	300124	汇川技术	7,669,339.50	4.79
340	601339	百隆东方	7,662,100.00	4.79
341	300331	苏大维格	7,500,765.00	4.69
342	600519	贵州茅台	7,498,009.00	4.69
343	000338	潍柴动力	7,325,040.00	4.58
344	600066	宇通客车	7,315,929.12	4.57
345	600584	长电科技	7,042,300.00	4.40
346	002272	川润股份	7,035,130.00	4.40
347	603889	新澳股份	6,862,121.00	4.29
348	000510	新金路	6,850,963.00	4.28
349	601138	工业富联	6,805,260.00	4.25
350	000550	江铃汽车	6,731,305.10	4.21
351	688256	寒武纪	6,728,111.76	4.20
352	600233	圆通速递	6,673,520.00	4.17
353	601058	赛轮轮胎	6,652,626.00	4.16
354	600754	锦江酒店	6,564,724.00	4.10

355	300979	华利集团	6,552,336.00	4.09
356	300499	高澜股份	6,496,293.20	4.06
357	300171	东富龙	6,477,537.60	4.05
358	002463	沪电股份	6,236,629.00	3.90
359	603238	诺邦股份	6,086,171.00	3.80
360	603112	华翔股份	5,987,040.00	3.74
361	300408	三环集团	5,945,042.00	3.71
362	688615	合合信息	5,903,485.81	3.69
363	601880	辽港股份	5,898,616.00	3.69
364	688087	英科再生	5,841,608.69	3.65
365	603861	白云电器	5,720,523.00	3.57
366	600623	华谊集团	5,718,463.00	3.57
367	002741	光华科技	5,704,719.00	3.56
368	301486	致尚科技	5,696,782.00	3.56
369	001376	百通能源	5,667,011.00	3.54
370	603236	移远通信	5,617,860.00	3.51
371	603061	金海通	5,394,183.00	3.37
372	300584	海辰药业	5,278,874.00	3.30
373	002484	江海股份	5,258,485.00	3.29
374	000036	华联控股	5,170,523.00	3.23
375	002142	宁波银行	5,044,199.00	3.15
376	920640	富士达	4,861,803.35	3.04
377	688150	莱特光电	4,814,181.25	3.01
378	688046	药康生物	4,806,787.58	3.00
379	688091	上海谊众	4,606,720.77	2.88
380	300170	汉得信息	4,599,134.00	2.87
381	688293	奥浦迈	4,564,836.87	2.85
382	301662	宏工科技	4,556,420.56	2.85
383	603124	江南新材	4,519,044.00	2.82
384	300870	欧陆通	4,284,822.00	2.68
385	002460	赣锋锂业	4,275,649.00	2.67
386	300033	同花顺	4,043,818.00	2.53
387	301629	矽电股份	4,023,142.00	2.51
388	601211	国泰海通	3,901,584.00	2.44
389	000419	通程控股	3,892,484.00	2.43
390	000488	ST 晨鸣	3,885,380.00	2.43
391	688525	佰维存储	3,865,749.17	2.42
392	600711	盛屯矿业	3,753,864.00	2.35
393	300390	天华新能	3,689,467.00	2.31
394	601886	江河集团	3,689,147.00	2.31
395	600367	红星发展	3,646,505.00	2.28
396	600998	九州通	3,626,221.00	2.27
397	301216	万凯新材	3,484,337.00	2.18
398	688248	南网科技	3,390,736.36	2.12

399	605377	华旺科技	3,298,430.00	2.06
400	688331	荣昌生物	3,239,198.38	2.02

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	12,471,810,042.28
卖出股票收入（成交）总额	11,190,860,575.31

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）	2,757,922.08	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,757,922.08	0.12

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	123270	盛德转债	11,433	2,589,610.52	0.12
2	127112	尚太转债	521	86,310.30	0.00
3	118071	华峰转债	820	82,001.26	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,198,469.75
2	应收清算款	52,179,152.44
3	应收股利	8,369.77
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,741,375.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,127,367.47

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	42,462	11,462.40	207,028,474.86	42.54%	279,687,786.15	57.46%
易方达科鑫量化选股股票发起式C	53,957	8,617.77	197,555,394.33	42.49%	267,433,409.58	57.51%
合计	96,419	9,870.51	404,583,869.19	42.51%	547,121,195.73	57.49%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	93.79%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	34,101,328.43	7.0064%
	易方达科鑫量化选股股票发起式 C	3,454,249.80	0.7429%
	合计	37,555,578.23	3.9461%

8.4 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	>100
	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

8.5 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	1.0507%	10,000,000.00	1.0507%	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	1.0507%	10,000,000.00	1.0507%	-

§ 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	76,736,099.88	27,020,008.01
本报告期基金总申购份额	531,865,682.89	671,527,328.50
减：本报告期基金总赎回份额	121,885,521.76	233,558,532.60

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	486,716,261.01	464,988,803.91

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项；本报告期内无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		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	4,660,812,981.34	19.70%	997,855.69	20.80%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	18,999,430,624.91	80.30%	3,799,925.48	79.20%	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	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华安证券股份有限公司、江海证券有限公司，无新增交易单元。

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

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

c）本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
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	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	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	证券日报、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	2026-01-15
4	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	证券日报	2026-01-22
5	易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金暂停大额申购及大额转换转入业务的公告	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	2026-01-29
6	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
7	易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2026-02-26
8	易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制的公告	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	2026-03-05
9	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
10	关于易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金 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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
11	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	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
13	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	证券日报	2026-03-31
14	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	证券日报	2026-04-22
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
16	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
17	易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务限制	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2026-05-08

	的公告	子披露网站	
18	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
19	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
20	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
21	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
22	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	证券日报、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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 01 月 21 日 ~2026 年 02 月 25 日	0.00	193,261,025 .10	9,270,659.5 0	183,990,365. 60	19.33 %
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。							

§ 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