

# 易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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：二〇二六年三月三十一日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 4 月 29 日起至 12 月 31 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 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	56

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6	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	76
8.7	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	77
8.8	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	77
8.9	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	77
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	77
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12	投资组合报告附注	77
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>78</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3	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	79
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>79</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>80</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	80
11.2	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	80
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4	基金投资策略的改变	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8	其他重大事件	82
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>84</b>
12.1	备查文件目录	84
12.2	存放地点	84
12.3	查阅方式	84

## § 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	483,687,635.55 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	106,039,141.58 份	377,648,493.97 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	<p>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。</p> <p>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。</p>

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31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
本期已实现收益	22,533,858.56	55,523,520.19
本期利润	50,089,960.46	93,064,369.90
加权平均基金份额本期利润	0.3819	0.2626
本期加权平均净值利润率	31.60%	21.27%
本期基金份额净值增长率	40.72%	40.34%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
	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	18,787,956.94	65,561,844.30
期末可供分配基金份额利	0.1772	0.1736

润		
期末基金资产净值	149,217,660.68	529,987,801.09
期末基金份额净值	1.4072	1.4034
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	
	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	40.72%	40.34%

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。

4.本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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	-2.58%	1.63%	-4.41%	1.54%	1.83%	0.09%
过去六个月	34.75%	1.63%	31.32%	1.60%	3.43%	0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	40.72%	1.47%	38.97%	1.47%	1.75%	0.00%

##### 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	-2.68%	1.63%	-4.41%	1.54%	1.73%	0.09%
过去六个月	34.49%	1.63%	31.32%	1.60%	3.17%	0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	40.34%	1.47%	38.97%	1.47%	1.37%	0.00%

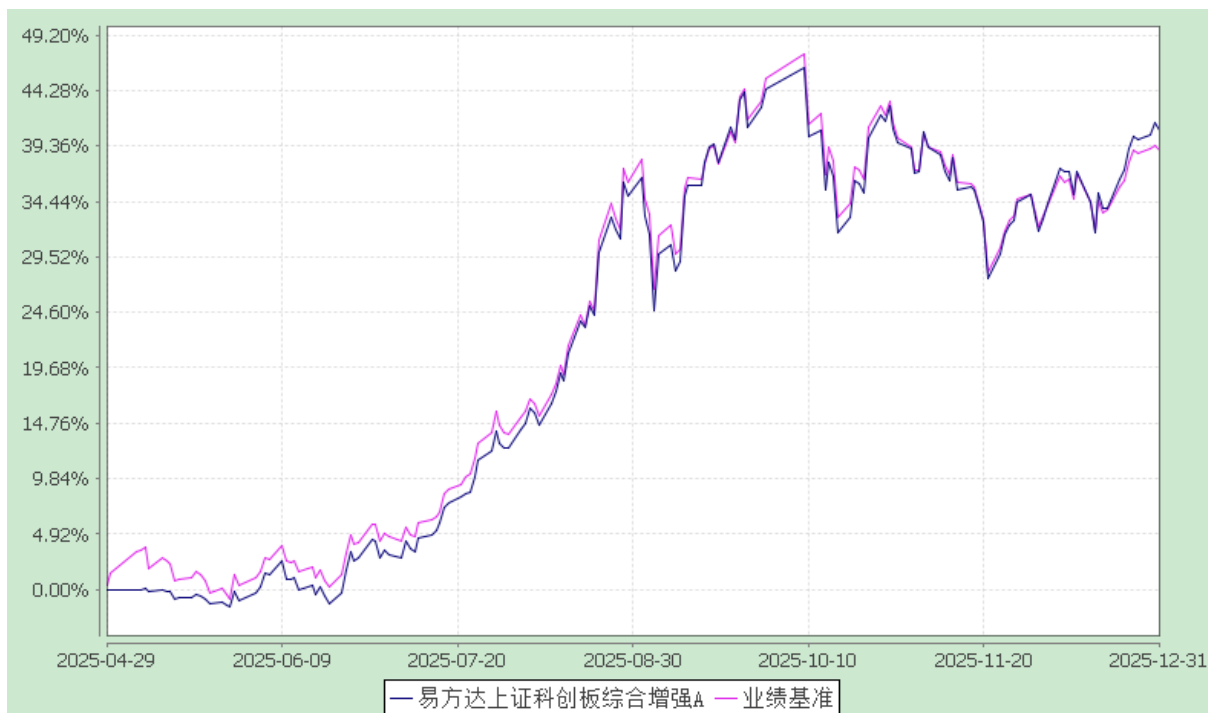
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

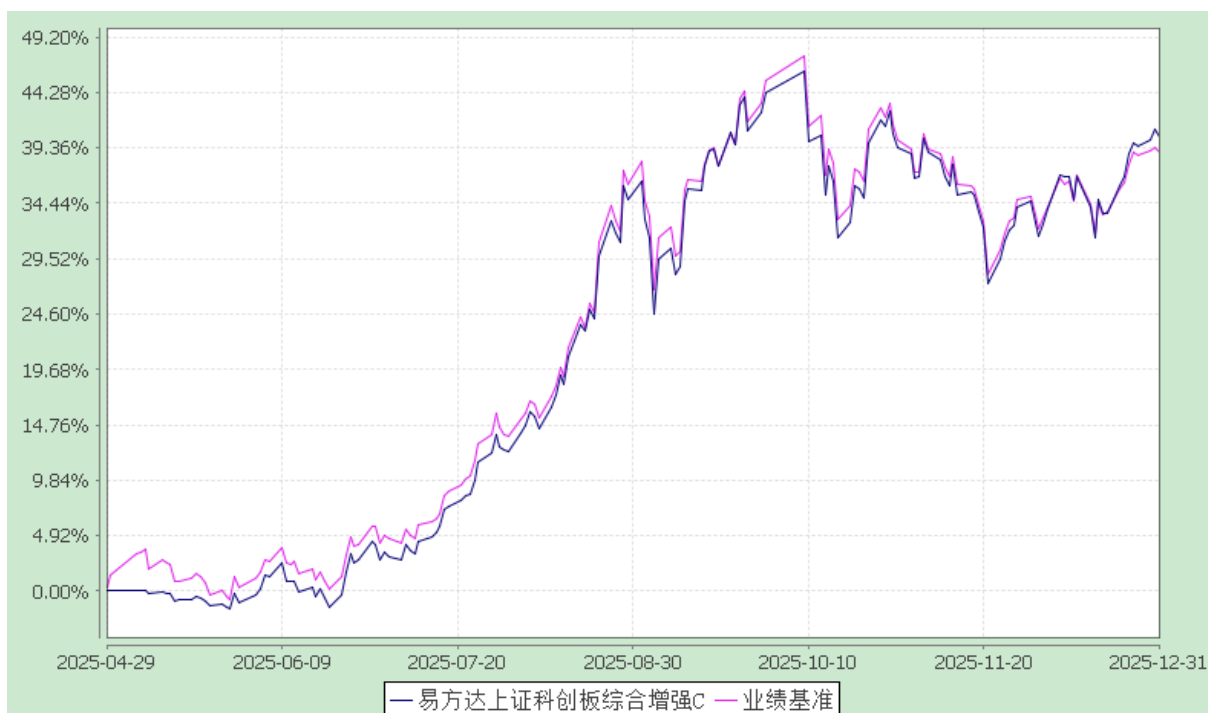
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025 年 4 月 29 日至 2025 年 12 月 31 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：1.本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

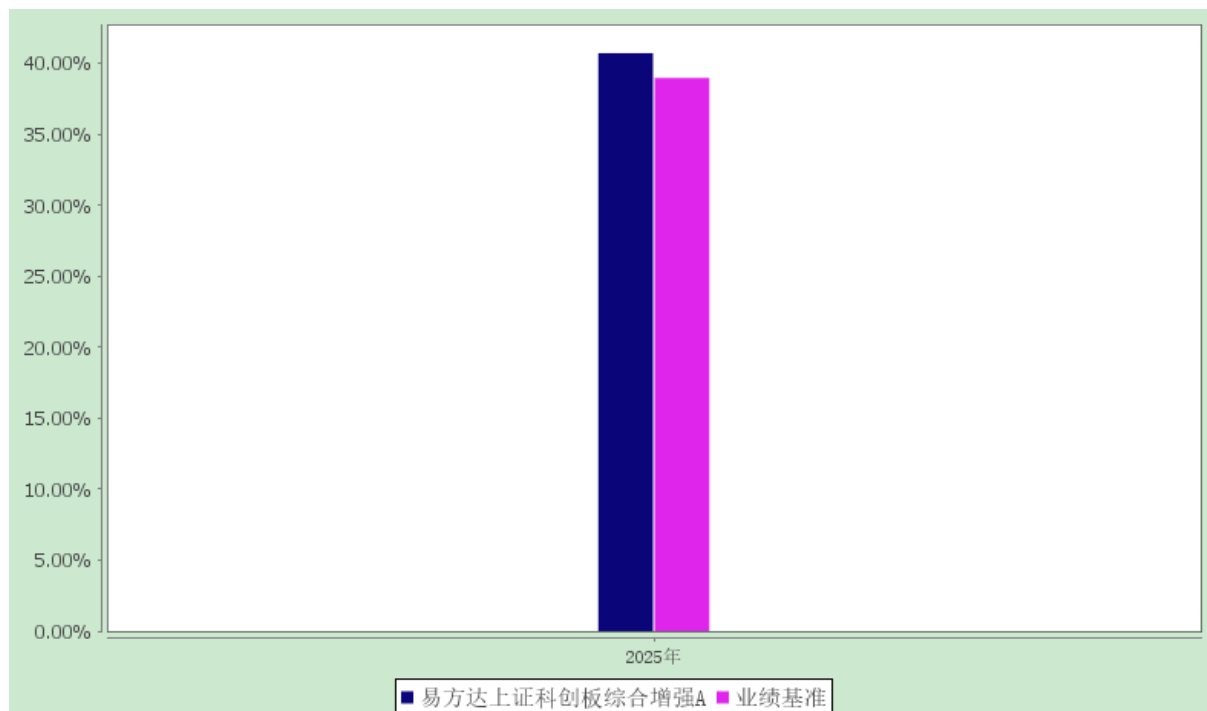
2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

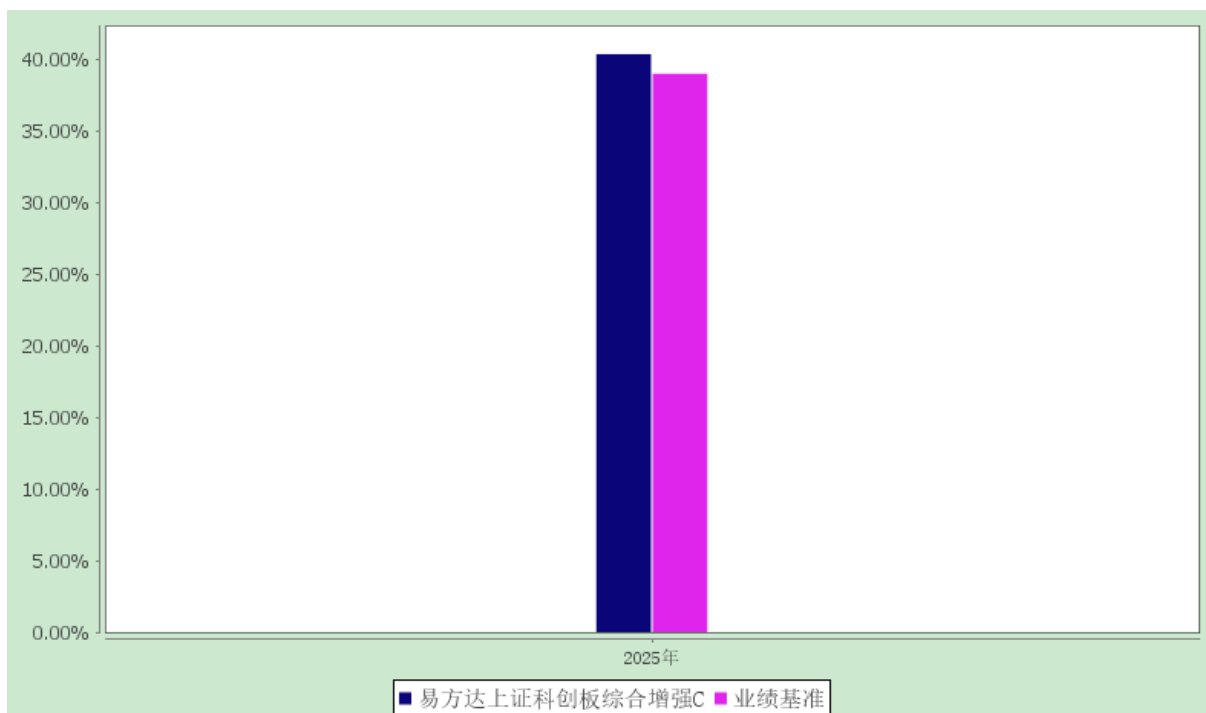
易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

#### 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：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2025 年 4 月 29 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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	2025-04-29	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，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。
----	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------	---	-----	----------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、

合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 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

回顾本报告期，市场在 2024 年反弹基础上持续发力，全年以 2025 年一季报披露为重要时间节点，呈现“前稳后强、科技领涨”的鲜明特征。全年维度，成交量整体保持温和放量态势，波动率逐步回归合理区间，前期表现突出的红利资产有所回调，而科技成长赛道成为全年主线，其中科创板作为科技自主可控的核心载体，表现尤为亮眼。科创综指全年延续强劲上涨势头，显著跑赢沪深 300、中证 500 等主流宽基指数，作为科创板上市公司纳入比率最多的指数，科创综指全年表现很好地反映了“高质量发展”的成色。

在报告期内，宏观和中观层面均呈现出诸多积极变化，同时也存在部分结构性挑战，共同塑造了全年科技板块的投资环境。宏观层面，国内 GDP 稳步攀升，经济高质量发展成效持续显现，为科技产业发展奠定了坚实的经济基础。生产方面，全国规模以上工业增加值同比增长，服务业保持稳健回升态势。中观层面，科技领域迎来多重发展机遇，机器人、算力芯片、商业航天、固态电池等多点开花，但同时也面临持续的外部挑战，自主可控势在必行。

作为指数增强产品，本基金成立以来，在保证紧密跟踪科创综指的前提下，完成了相对科创综指的增强目标。具体来说，本基金在本年度的运作分为建仓期和平稳运作期两部分。建仓期，我们使用了平稳建仓的方案，虽然此阶段科创综指有所上涨，但我们用较低的仓位基本跟踪住了指数的上涨；建仓完成之后，产品进入正常的指数增强策略运作阶段，通过良好的选股模型，取得了一定的超额收益。

本产品作为场外的科创综指增强产品，区别于场内增强 ETF（易方达上证科创板综合增强策略 ETF，代码 588550），在投资策略和产品特性上略有不同。考虑到场内产品需要流动性，且每日披露交易持仓，因此更适合使用低换手的基本面策略；而场外产品无此要求，因此可以使用的策略更加多样化，除了基本面策略以外，还可以纳入统计套利、机器学习等相对中等换手率的策略，投资策略更加丰富。两者虽然在投资策略使用上略有不同，但作为指数增强型基金的投资目标是一致的：在紧密跟踪科创综指基准的基础上，做出稳健可持续的超额收益，追求投资收益和风险比（信息比率）的最大化。我们建议投资者根据不同的投资配置需求选择不同类型的策略产品。

此外，值得一提的是，作为通过量化策略进行管理的基金，我们在 2025 年除了对模型进行日常的迭代研究外，还特别使用了新的 AI 工具帮助我们搭建量化模型。在过去的一年里，我们已经借助 Claude Code 搭建了新的量化投研框架，将新的量化策略快速通过 AI 编码进行实现。新的一年，我们还会进一步借助 AI Agent 框架，通过 Skills 定义好不同的量化策略 Agent，包括回测、监控、验证、组合等。后续我们也会在基金定期报告中向各位投资者更新 AI 模型的迭代情况。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4072 元，本报告期份额净值增长率为 40.72%，同期业绩比较基准收益率为 38.97%；C 类基金份额净值为 1.4034 元，本报告期份额净值增长率为 40.34%，同期业绩比较基准收益率为 38.97%。年化跟踪误差 4.49%，超过目标控制范围，因本报告期包含了建仓期，故跟踪误差等指标在调整之中。

#### 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 2026 年，国内整体经济活力有望进一步回暖，尤其是当前 AI 对各大行业的拉动效应已经逐渐显现，有望在新的一年里成为经济增长的重要力量，也有望对 PPI 产生一定拉动作用，从而使经济基本面从“量升价平”逐步走向更加健康的“量价齐升”。因此，在这样的背景下，我们建议投资者除了继续关注下游科技领域的投资机会外，可以将目光进一步扩散至中上游的材料和制造环节，例如半导体材料、锂电设备、小金属、能源化工等。

科创综指作为科创板上市公司“全打包”指数，其科创板覆盖率达到 97% 以上，囊括了科技上中下游各产业链环节的公司。如果说科创 50 作为科创板大市值代表，更多反映的是国产算力、生物医

药等大市值龙头的特征，那么科创综指则更加全面，从上游有色化工，到中下游电力设备新能源、电子均有涉及。作为指数增强型基金，这正是这类产品的特色：“投资者可以放弃选择困难症，一揽子打包科技资产，让量化模型做选择”。我们认为，虽然新的一年科技投资机会非常丰富，但随着市场交易量更加活跃，市场波动也可能逐步加大，此时如果简单追高热点板块反而可能无法获得很好的投资收益，而指数增强型基金通过量化模型进行投资，更擅长规避情绪化投资的问题。

我们将继续从自上而下以及自下而上两个角度进行深入研究，通过量化模型紧密跟踪相关数据，快速准确地做出投资决策。目前，我们的投资策略融合了宏观政策、中观景气度、微观基本面等不同信息，同时，充分依托在大数据、机器学习、另类数据中的深入研究，通过多策略投资的方式提高策略的稳定性，力争在 2026 年继续给投资者带来较好的资产回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

(1) 坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级

的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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遵规守信、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 托管人对本年度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 审计报告

安永华明（2026）审字第 70013033\_G186 号

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 林亚小

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2026年3月26日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
----	-----	--------------------

<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	48,587,924.76
结算备付金		7,079,415.94
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	642,846,400.45
其中：股票投资		642,749,693.94
基金投资		-
债券投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,076,165.36
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
<b>资产总计</b>		<b>702,589,906.51</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		22,569,234.95
应付管理人报酬		498,350.66

应付托管费		62,293.82
应付销售服务费		196,830.14
应付投资顾问费		-
应交税费		0.06
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	57,735.11
<b>负债合计</b>		<b>23,384,444.74</b>
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	483,687,635.55
未分配利润	7.4.7.8	195,517,826.22
<b>净资产合计</b>		<b>679,205,461.77</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>702,589,906.51</b>

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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2025 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.4072 元，C 类基金份额净值 1.4034 元；基金份额总额 483,687,635.55 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 106,039,141.58 份，C 类基金份额总额 377,648,493.97 份。

## 7.2 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：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>148,065,305.03</b>
1.利息收入		279,866.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	279,866.10
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）		82,293,259.32
其中：股票投资收益	7.4.7.10	77,695,725.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	64,653.80
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	2,657,448.18
股利收益	7.4.7.14	1,875,431.37
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	65,096,951.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	395,228.00
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,910,974.67</b>
1. 管理人报酬		3,246,266.96
2. 托管费		405,783.30
3. 销售服务费		1,193,734.94
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	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		9,594.38
8. 其他费用	7.4.7.18	55,595.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>143,154,330.36</b>
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		143,154,330.36
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		143,154,330.36

注：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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 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：2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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）	-98,555,785.50	195,517,826.22	96,962,040.72
（一）、综合收益总额	-	143,154,330.36	143,154,330.36
（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）	-98,555,785.50	52,363,495.86	-46,192,289.64
其中：1.基金申购款	1,320,696,163.25	425,878,233.45	1,746,574,396.70
2.基金赎回款	-1,419,251,948.75	-373,514,737.59	-1,792,766,686.34
（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	483,687,635.55	195,517,826.22	679,205,461.77

注：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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

本基金募集期间为 2025 年 4 月 14 日至 2025 年 4 月 25 日，募集金额总额为人民币 582,243,421.05 元，其中：有效净认购金额为人民币 582,118,381.06 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 125,039.99 元，经安永华明（2025）验字第 70013033\_G13 号验资报告予以审验。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

###### （2）金融负债分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，

本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债

的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动

分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

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

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

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

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策

的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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 号文《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 号文《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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 12 月 31 日	
活期存款	21,251,468.18	
等于：本金	21,250,461.56	
加：应计利息	1,006.62	
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	27,336,456.58	
等于：本金	27,333,481.92	
加：应计利息	2,974.66	
合计	48,587,924.76	

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。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	577,658,547.33	-	642,749,693.94	65,091,146.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	90,899.83	1.68	96,706.51	5,805.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	90,899.83	1.68	96,706.51	5,805.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	577,749,447.16	1.68	642,846,400.45	65,096,951.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,735.11
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	55,000.00
合计	57,735.11

#### 7.4.7.7 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 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	154,987,518.31	154,987,518.31
本期申购	203,749,481.54	203,749,481.54
本期赎回（以“-”号填列）	-252,697,858.27	-252,697,858.27
本期末	106,039,141.58	106,039,141.58

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	
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	427,255,902.74	427,255,902.74
本期申购	1,116,946,681.71	1,116,946,681.71
本期赎回（以“-”号填列）	-1,166,554,090.48	-1,166,554,090.48
本期末	377,648,493.97	377,648,493.97

注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效，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。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,533,858.56	27,556,101.90	50,089,960.46
本期基金份额交易产生的变动数	-3,745,901.62	-3,165,539.74	-6,911,441.36
其中：基金申购款	16,382,800.92	39,664,926.00	56,047,726.92
基金赎回款	-20,128,702.54	-42,830,465.74	-62,959,168.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,787,956.94	24,390,562.16	43,178,519.10

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	55,523,520.19	37,540,849.71	93,064,369.90
本期基金份额交易产生的变动数	10,038,324.11	49,236,613.11	59,274,937.22
其中：基金申购款	111,536,530.36	258,293,976.17	369,830,506.53
基金赎回款	-101,498,206.25	-209,057,363.06	-310,555,569.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,561,844.30	86,777,462.82	152,339,307.12

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	34,421.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	187,990.69
结算备付金利息收入	57,204.19
其他	249.40
合计	279,866.10

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	77,695,725.97
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	77,695,725.97

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	987,856,502.94
减：卖出股票成本总额	909,266,861.49
减：交易费用	893,915.48
买卖股票差价收入	77,695,725.97

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	12.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	64,641.64
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	64,653.80

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	181,660.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	116,999.51
减：应计利息总额	11.63
减：交易费用	7.25
买卖债券差价收入	64,641.64

## 7.4.7.12 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。

## 7.4.7.13 衍生工具收益

## 7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股指期货投资收益	2,657,448.18

## 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,875,431.37
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	1,875,431.37

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	65,096,951.61
——股票投资	65,091,146.61
——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	65,096,951.61

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	394,804.10
其他	423.90
合计	395,228.00

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	55,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
存托服务费	160.11
港股通证券组合费	34.98
其他	400.00
合计	55,595.09

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9关联方关系

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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
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
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,246,266.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,501,563.54
应支付基金管理人的净管理费	1,744,703.42

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	405,783.30

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31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	-	4,171.81	4,171.81
平安银行	-	69,935.14	69,935.14
广发证券	-	115.66	115.66
合计	-	74,222.61	74,222.61

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期存款	21,251,468.18	34,421.82

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。

#### 7.4.10.7 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 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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
万联证券股份有限公司	001396	誉帆科技	新股发行	688	15,335.52
广发证券股份有限公司	688795	摩尔线程	新股发行	4,640	530,259.20
广发证券股份有限公司	688805	健信超导	新股发行	2,643	49,106.94

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001280	中国铝业	2025-11-25	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-

001386	马可波罗	2025-10-15	6 个月	新股 流通 受限	13.75	18.53	1,564	21,505.00	28,980.92	-
001396	誉帆 科技	2025-12-23	6 个月	新股 流通 受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301638	南网 数字	2025-11-11	6 个月	新股 流通 受限	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301667	纳百 川	2025-12-10	6 个月	新股 流通 受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301687	新广 益	2025-12-24	6 个月	新股 流通 受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生 天合	2025-10-09	6 个月	新股 流通 受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力 佳	2025-10-30	6 个月	新股 流通 受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖 电子	2025-10-17	6 个月	新股 流通 受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华 科技	2025-12-16	6 个月	新股 流通 受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源 集团	2025-07-16	6 个月	新股 流通 受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍 生物	2025-10-29	6 个月	新股 流通 受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新 精科	2025-08-27	6 个月	新股 流通 受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603406	天富 龙	2025-07-30	6 个月	新股 流通 受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升 股份	2025-09-16	6 个月	新股 流通 受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤 新材	2025-11-11	6 个月	新股 流通	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-

				受限						
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	新股 流通 受限	8.45	24.28	2,099	17,736.55	50,963.72	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股 流通 受限	17.78	25.13	12,552	223,174.56	315,431.76	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股 流通 受限	8.62	18.39	25,143	216,732.66	462,379.77	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股 流通 受限	83.06	117.0 7	2,319	192,616.14	271,485.33	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股 流通 受限	114.28	416.0 2	3,248	371,181.44	1,351,232.9 6	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新股 流通 受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股 流通 受限	104.66	399.4 0	2,230	233,391.80	890,662.00	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新股 流通 受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新股 流通 受限	51.66	135.5 6	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新股 流通 受限	85.09	203.3 1	242	20,591.78	49,201.02	-

## 7.4.12.1.2 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
118063	金 05 转债	2025-12-26	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.0 0	780	78,000.00	78,001.03	-

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。

## 7.4.12.2 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
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	283.75	2026-01-05	278.00	43,946	9,992,574.39	12,469,677.50	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2025 年 12 月 31 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 0.01%。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00

合计	0.00
----	------

## 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	96,706.51
未评级	0.00
合计	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。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受

限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
					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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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

## 7.4.13.4.2 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 2025年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-9,312.20
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	9,312.20

## 7.4.13.4.3 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	642,749,693.94	94.63
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	642,749,693.94	94.63

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	33,828,931.26
	2.业绩比较基准下降 5%	-33,828,931.26

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	626,592,626.81
第二层次	12,547,678.53
第三层次	3,706,095.11
合计	642,846,400.45

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	1,429,249.25	1,429,249.25
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,943.48	2,943.48
当期利得或损失总额	-	2,279,789.34	2,279,789.34
其中：计入损益的利得或损失	-	2,279,789.34	2,279,789.34
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	3,706,095.11	3,706,095.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,277,979.02	2,277,979.02

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	3,706,095.11	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.18—3.0323	负相关

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	642,749,693.94	91.48
	其中：股票	642,749,693.94	91.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	96,706.51	0.01
	其中：债券	96,706.51	0.01
	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	55,667,340.70	7.92
8	其他各项资产	4,076,165.36	0.58
9	合计	702,589,906.51	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 186,243.96 元，占净值比例 0.03%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 8.2.1.1 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	424,937,123.20	62.56
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	115,162,886.83	16.96

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	7,143,432.24	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	865,022.73	0.13
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	548,108,465.00	80.70

## 8.2.1.2 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	1,329,759.72	0.20
C	制造业	79,217,819.38	11.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	352,590.00	0.05
F	批发和零售业	1,082,550.00	0.16
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	9,739,162.22	1.43
J	金融业	170,131.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,868,331.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	20,313.66	0.00
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	409,654.00	0.06
S	综合	264,674.00	0.04
	合计	94,454,984.98	13.91

### 8.2.2 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	186,243.96	0.03
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	186,243.96	0.03

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	30,476	41,311,741.80	6.08
2	688041	海光信息	163,968	36,796,058.88	5.42
3	688981	中芯国际	168,141	20,652,759.03	3.04
4	688012	中微公司	43,946	12,469,677.50	1.84
5	688008	澜起科技	91,611	10,791,775.80	1.59
6	688111	金山办公	29,860	9,169,110.20	1.35
7	688506	百利天恒	19,959	6,448,752.90	0.95
8	688775	影石创新	25,574	6,007,332.60	0.88
9	688183	生益电子	61,466	5,881,681.54	0.87
10	688521	芯原股份	42,427	5,811,226.19	0.86

11	688072	拓荆科技	16,297	5,378,010.00	0.79
12	688347	华虹公司	41,953	4,525,470.11	0.67
13	688303	大全能源	161,919	4,342,667.58	0.64
14	688249	晶合集成	123,241	4,090,368.79	0.60
15	688702	盛科通信	27,646	3,917,161.74	0.58
16	688223	晶科能源	662,973	3,739,167.72	0.55
17	688120	华海清科	24,787	3,720,032.96	0.55
18	688082	盛美上海	20,896	3,678,740.80	0.54
19	688126	沪硅产业	168,323	3,642,509.72	0.54
20	688525	佰维存储	31,204	3,581,907.16	0.53
21	688498	源杰科技	5,504	3,533,512.96	0.52
22	688110	东芯股份	25,176	3,306,867.60	0.49
23	688608	恒玄科技	14,566	3,305,608.04	0.49
24	688578	艾力斯	30,228	3,148,246.20	0.46
25	688220	翱捷科技	37,977	3,137,279.97	0.46
26	688017	绿的谐波	16,013	3,076,097.30	0.45
27	688535	华海诚科	27,404	3,071,440.32	0.45
28	688375	国博电子	32,922	3,065,367.42	0.45
29	688599	天合光能	182,306	3,017,164.30	0.44
30	688235	百济神州	11,208	3,010,468.80	0.44
31	688271	联影医疗	23,816	2,988,908.00	0.44
32	688343	云天励飞	38,863	2,956,697.04	0.44
33	688629	华丰科技	29,505	2,952,270.30	0.43
34	688322	奥比中光	32,854	2,946,018.18	0.43
35	688361	中科飞测	18,287	2,797,728.13	0.41
36	688172	燕东微	96,549	2,794,128.06	0.41
37	688336	三生国健	43,932	2,617,029.24	0.39
38	688318	财富趋势	19,690	2,605,380.80	0.38
39	688031	星环科技	24,023	2,599,048.37	0.38
40	688778	厦钨新能	33,130	2,563,268.10	0.38
41	688002	睿创微纳	25,224	2,542,579.20	0.37
42	688036	传音控股	38,288	2,533,134.08	0.37
43	688099	晶晨股份	28,896	2,520,598.08	0.37
44	688019	安集科技	11,021	2,401,696.32	0.35
45	688297	中无人机	48,388	2,323,591.76	0.34
46	688472	阿特斯	153,898	2,294,619.18	0.34
47	688195	腾景科技	13,507	2,290,111.85	0.34
48	688313	仕佳光子	24,320	2,159,129.60	0.32
49	688728	格科微	143,833	2,148,865.02	0.32
50	688114	华大智造	35,062	2,130,367.12	0.31
51	688037	芯源微	14,225	2,112,554.75	0.31
52	688568	中科星图	35,756	2,109,604.00	0.31
53	688523	航天环宇	37,376	2,091,560.96	0.31
54	688122	西部超导	27,945	2,084,138.10	0.31

55	688095	福昕软件	23,279	2,078,116.33	0.31
56	688200	华峰测控	10,703	2,035,710.60	0.30
57	688396	华润微	38,136	2,015,868.96	0.30
58	688385	复旦微电	26,914	1,983,561.80	0.29
59	688349	三一重能	76,141	1,924,844.48	0.28
60	688692	达梦数据	7,351	1,920,595.77	0.28
61	688772	珠海冠宇	88,734	1,910,443.02	0.28
62	688116	天奈科技	39,587	1,866,527.05	0.27
63	688208	道通科技	50,552	1,860,313.60	0.27
64	688627	精智达	8,150	1,822,258.50	0.27
65	688469	芯联集成	270,154	1,807,330.26	0.27
66	688005	容百科技	50,977	1,804,585.80	0.27
67	688353	华盛锂电	15,815	1,798,165.50	0.26
68	688048	长光华芯	14,289	1,791,126.15	0.26
69	688676	金盘科技	19,752	1,784,395.68	0.26
70	688018	乐鑫科技	10,488	1,782,960.00	0.26
71	688698	伟创电气	17,785	1,758,580.80	0.26
72	688561	奇安信	48,256	1,716,948.48	0.25
73	688536	思瑞浦	10,713	1,712,794.44	0.25
74	688433	华曙高科	25,788	1,706,391.96	0.25
75	688333	铂力特	15,247	1,700,192.97	0.25
76	688180	君实生物	48,762	1,665,709.92	0.25
77	688400	凌云光	39,137	1,658,626.06	0.24
78	688187	时代电气	32,043	1,643,485.47	0.24
79	688475	萤石网络	53,567	1,612,902.37	0.24
80	688192	迪哲医药	27,581	1,588,665.60	0.23
81	688777	中控技术	31,824	1,570,196.16	0.23
82	688499	利元亨	26,955	1,555,842.60	0.23
83	688155	先惠技术	25,632	1,549,454.40	0.23
84	688047	龙芯中科	11,476	1,516,094.36	0.22
85	688088	虹软科技	30,504	1,509,948.00	0.22
86	688362	甬矽电子	45,643	1,479,289.63	0.22
87	688559	海目星	30,684	1,474,673.04	0.22
88	688327	云从科技	101,824	1,463,210.88	0.22
89	688167	炬光科技	8,324	1,457,282.68	0.21
90	688518	联赢激光	59,886	1,454,630.94	0.21
91	688306	均普智能	125,147	1,451,705.20	0.21
92	688141	杰华特	33,278	1,445,263.54	0.21
93	688582	芯动联科	21,830	1,443,181.30	0.21
94	688006	杭可科技	48,803	1,429,439.87	0.21
95	688147	微导纳米	22,729	1,427,153.91	0.21
96	688819	天能股份	42,799	1,421,782.78	0.21
97	688281	华秦科技	19,249	1,420,576.20	0.21
98	688123	聚辰股份	10,982	1,379,119.56	0.20

99	688295	中复神鹰	41,841	1,372,803.21	0.20
100	688063	派能科技	24,056	1,366,861.92	0.20
101	688009	中国通号	247,588	1,354,306.36	0.20
102	688205	德科立	9,785	1,345,241.80	0.20
103	688390	固德威	21,532	1,337,783.16	0.20
104	688300	联瑞新材	21,210	1,316,928.90	0.19
105	688352	颀中科技	102,622	1,294,063.42	0.19
106	688519	南亚新材	15,773	1,275,404.78	0.19
107	688166	博瑞医药	25,935	1,272,371.10	0.19
108	688084	晶品特装	15,351	1,271,062.80	0.19
109	688068	热景生物	7,823	1,267,326.00	0.19
110	688387	信科移动	98,180	1,266,522.00	0.19
111	688234	天岳先进	13,974	1,242,009.12	0.18
112	688615	合合信息	5,447	1,239,628.26	0.18
113	688686	奥普特	9,981	1,238,941.53	0.18
114	688709	成都华微	26,753	1,230,370.47	0.18
115	688331	荣昌生物	15,781	1,227,603.99	0.18
116	688062	迈威生物	31,853	1,225,384.91	0.18
117	688543	国科军工	19,472	1,208,627.04	0.18
118	688550	瑞联新材	26,278	1,190,656.18	0.18
119	688233	神工股份	16,998	1,190,369.94	0.18
120	688567	孚能科技	73,612	1,152,027.80	0.17
121	688169	石头科技	7,557	1,149,117.42	0.17
122	689009	九号公司	20,646	1,147,711.14	0.17
123	688160	步科股份	7,400	1,128,500.00	0.17
124	688188	柏楚电子	8,251	1,121,228.39	0.17
125	688131	皓元医药	15,488	1,116,375.04	0.16
126	688800	瑞可达	13,414	1,113,362.00	0.16
127	688700	东威科技	31,111	1,097,596.08	0.16
128	688321	微芯生物	37,145	1,085,376.90	0.16
129	688625	呈和科技	26,034	1,072,600.80	0.16
130	688708	佳驰科技	17,221	1,072,007.25	0.16
131	688798	艾为电子	13,890	1,057,167.90	0.16
132	688027	国盾量子	2,094	1,054,936.26	0.16
133	688388	嘉元科技	25,591	1,048,719.18	0.15
134	688668	鼎通科技	8,411	1,042,964.00	0.15
135	688372	伟测科技	9,505	1,036,900.45	0.15
136	688052	纳芯微	6,515	1,030,542.70	0.15
137	688065	凯赛生物	20,580	1,024,884.00	0.15
138	688617	惠泰医疗	4,201	1,021,977.27	0.15
139	688443	智翔金泰	36,944	1,006,354.56	0.15
140	688678	福立旺	41,435	1,001,898.30	0.15
141	688556	高测股份	87,731	1,001,888.02	0.15
142	688432	有研硅	80,542	999,526.22	0.15

143	688143	长盈通	19,736	990,944.56	0.15
144	688278	特宝生物	11,816	988,762.88	0.15
145	688258	卓易信息	12,864	984,996.48	0.15
146	688182	灿勤科技	33,322	983,665.44	0.14
147	688549	中巨芯	107,101	976,761.12	0.14
148	688100	威胜信息	24,560	965,208.00	0.14
149	688301	奕瑞科技	9,522	962,769.42	0.14
150	688326	经纬恒润	8,150	957,625.00	0.14
151	688435	英方软件	20,169	943,304.13	0.14
152	688001	华兴源创	31,232	942,581.76	0.14
153	688127	蓝特光学	24,446	940,926.54	0.14
154	688449	联芸科技	20,710	935,677.80	0.14
155	688238	和元生物	137,844	918,041.04	0.14
156	688585	上纬新材	6,975	888,405.75	0.13
157	688690	纳微科技	34,200	882,702.00	0.13
158	688502	茂莱光学	2,149	857,558.45	0.13
159	688049	炬芯科技	16,299	857,327.40	0.13
160	688484	南芯科技	20,914	850,363.24	0.13
161	688190	云路股份	8,597	837,347.80	0.12
162	688206	概伦电子	23,948	834,108.84	0.12
163	688612	威迈斯	25,174	829,986.78	0.12
164	688458	美芯晟	20,841	826,137.24	0.12
165	688409	富创精密	12,203	822,482.20	0.12
166	688766	普冉股份	6,422	816,942.62	0.12
167	688153	唯捷创芯	21,634	814,303.76	0.12
168	688356	键凯科技	9,830	808,026.00	0.12
169	688577	浙海德曼	8,255	799,579.30	0.12
170	688717	艾罗能源	12,965	798,644.00	0.12
171	688032	禾迈股份	7,746	780,719.34	0.11
172	688510	航亚科技	28,966	779,185.40	0.11
173	688425	铁建重工	153,443	777,956.01	0.11
174	688373	盟科药业	128,431	775,723.24	0.11
175	688403	汇成股份	46,786	766,354.68	0.11
176	688685	迈信林	13,807	766,012.36	0.11
177	688663	新风光	19,387	751,633.99	0.11
178	688286	敏芯股份	9,484	748,761.80	0.11
179	688225	亚信安全	38,570	748,258.00	0.11
180	688779	五矿新能	99,147	742,611.03	0.11
181	688707	振华新材	53,324	738,537.40	0.11
182	688059	华锐精密	9,377	737,969.90	0.11
183	688025	杰普特	5,203	736,588.71	0.11
184	688097	博众精工	19,484	735,521.00	0.11
185	688630	芯碁微装	5,449	733,053.97	0.11
186	688259	创耀科技	17,463	729,953.40	0.11

187	688378	奥来德	26,727	729,647.10	0.11
188	688248	南网科技	16,189	724,295.86	0.11
189	688270	臻镭科技	5,928	723,630.96	0.11
190	688636	智明达	16,827	720,868.68	0.11
191	688369	致远互联	27,965	711,149.95	0.10
192	688652	京仪装备	7,212	709,011.72	0.10
193	688312	燕麦科技	21,219	704,046.42	0.10
194	688522	纳睿雷达	17,431	696,019.83	0.10
195	688289	圣湘生物	36,523	690,649.93	0.10
196	688252	天德钰	32,303	683,854.51	0.10
197	688416	恒烁股份	12,394	683,281.22	0.10
198	688320	禾川科技	18,292	682,657.44	0.10
199	688290	景业智能	11,448	680,469.12	0.10
200	688348	昱能科技	13,445	677,493.55	0.10
201	688584	上海合晶	30,811	675,993.34	0.10
202	688202	美迪西	11,985	675,954.00	0.10
203	688103	国力电子	11,098	672,427.82	0.10
204	688563	航材股份	11,500	672,175.00	0.10
205	688185	康希诺	10,624	667,718.40	0.10
206	688410	山外山	44,409	664,802.73	0.10
207	688371	菲沃泰	35,847	662,094.09	0.10
208	688687	凯因科技	26,452	659,183.84	0.10
209	688020	方邦股份	9,613	653,876.26	0.10
210	688660	电气风电	38,182	649,475.82	0.10
211	688189	南新制药	81,445	649,116.65	0.10
212	688255	凯尔达	17,385	636,812.55	0.09
213	688279	峰昭科技	3,108	632,446.92	0.09
214	688148	芳源股份	71,986	631,317.22	0.09
215	688003	天准科技	10,678	628,934.20	0.09
216	688135	利扬芯片	22,644	628,597.44	0.09
217	688106	金宏气体	31,940	625,704.60	0.09
218	688507	索辰科技	6,147	616,482.63	0.09
219	688319	欧林生物	24,244	614,827.84	0.09
220	688186	广大特材	26,990	612,133.20	0.09
221	688146	中船特气	15,131	611,292.40	0.09
222	688593	新相微	30,059	606,590.62	0.09
223	688691	灿芯股份	5,946	606,373.08	0.09
224	688168	安博通	8,026	603,234.16	0.09
225	688733	壹石通	20,808	603,015.84	0.09
226	688621	阳光诺和	9,681	601,674.15	0.09
227	688596	正帆科技	18,896	597,680.48	0.09
228	688363	华熙生物	13,650	596,232.00	0.09
229	688786	悦安新材	20,725	584,652.25	0.09
230	688590	新致软件	31,217	582,509.22	0.09

231	688639	华恒生物	17,796	579,793.68	0.09
232	688439	振华风光	8,953	578,363.80	0.09
233	688177	百奥泰	24,985	578,152.90	0.09
234	688768	容知日新	13,245	575,362.80	0.08
235	688275	万润新能	7,613	574,020.20	0.08
236	688191	智洋创新	17,731	570,583.58	0.08
237	688015	交控科技	25,015	569,841.70	0.08
238	688553	汇宇制药	31,977	568,870.83	0.08
239	688179	阿拉丁	45,322	566,071.78	0.08
240	688107	安路科技	20,825	566,023.50	0.08
241	688631	莱斯信息	8,250	561,660.00	0.08
242	688428	诺诚健华	27,370	561,632.40	0.08
243	688218	江苏北人	24,577	560,847.14	0.08
244	688661	和林微纳	10,798	558,904.48	0.08
245	688633	星球石墨	23,413	554,419.84	0.08
246	688548	广钢气体	37,926	551,444.04	0.08
247	688392	骄成超声	4,811	539,794.20	0.08
248	688486	龙迅股份	7,230	537,261.30	0.08
249	688228	开普云	2,750	535,177.50	0.08
250	688058	宝兰德	19,653	535,151.19	0.08
251	688239	航宇科技	7,885	533,577.95	0.08
252	688677	海泰新光	12,350	533,026.00	0.08
253	688799	华纳药厂	11,163	532,475.10	0.08
254	688173	希荻微	35,614	523,525.80	0.08
255	688159	有方科技	10,773	520,766.82	0.08
256	688277	天智航	34,246	520,196.74	0.08
257	688010	福光股份	16,609	516,872.08	0.08
258	688722	同益中	26,291	513,989.05	0.08
259	688101	三达膜	31,241	513,602.04	0.08
260	688039	当虹科技	11,411	510,642.25	0.08
261	688591	泰凌微	11,997	510,592.32	0.08
262	688538	和辉光电	191,619	509,706.54	0.08
263	688609	九联科技	49,872	509,193.12	0.07
264	688093	世华科技	13,810	508,898.50	0.07
265	688091	上海谊众	10,808	507,976.00	0.07
266	688201	信安世纪	34,681	507,383.03	0.07
267	688023	安恒信息	9,806	504,126.46	0.07
268	688280	精进电动	57,677	501,789.90	0.07
269	688579	山大地纬	44,948	484,539.44	0.07
270	688618	三旺通信	18,041	480,973.06	0.07
271	688305	科德数控	7,695	475,551.00	0.07
272	688697	纽威数控	30,778	473,365.64	0.07
273	688658	悦康药业	20,708	468,207.88	0.07
274	688557	兰剑智能	12,745	464,300.35	0.07

275	688776	国光电气	4,608	464,209.92	0.07
276	688098	申联生物	52,076	462,434.88	0.07
277	688199	久日新材	19,454	458,530.78	0.07
278	688029	南微医学	5,564	453,799.84	0.07
279	688030	山石网科	24,892	452,287.64	0.07
280	688226	威腾电气	12,132	450,097.20	0.07
281	688210	统联精密	8,130	449,751.60	0.07
282	688600	皖仪科技	17,934	449,246.70	0.07
283	688077	大地熊	14,657	447,771.35	0.07
284	688386	泛亚微透	5,109	447,548.40	0.07
285	688257	新锐股份	13,021	446,359.88	0.07
286	688022	瀚川智能	29,147	445,949.10	0.07
287	688466	金科环境	27,355	445,065.85	0.07
288	688288	鸿泉技术	16,590	444,777.90	0.07
289	688456	有研粉材	5,655	439,393.50	0.06
290	688004	博汇科技	18,690	432,299.70	0.06
291	688408	中信博	10,225	430,574.75	0.06
292	688138	清溢光电	15,219	428,567.04	0.06
293	688789	宏华数科	5,204	424,490.28	0.06
294	688659	元琛科技	44,235	418,020.75	0.06
295	688310	迈得医疗	27,239	417,573.87	0.06
296	688651	盛邦安全	9,293	409,077.86	0.06
297	688066	航天宏图	12,032	391,761.92	0.06
298	688108	赛诺医疗	20,150	387,686.00	0.06
299	688699	明微电子	9,079	385,948.29	0.06
300	688276	百克生物	20,369	384,159.34	0.06
301	688605	先锋精科	5,902	379,262.52	0.06
302	688158	优刻得	13,450	377,810.50	0.06
303	688196	卓越新能	6,364	374,839.60	0.06
304	688311	盟升电子	8,159	372,050.40	0.05
305	688380	中微半导	11,439	367,763.85	0.05
306	688520	神州细胞	8,304	359,646.24	0.05
307	688337	普源精电	9,749	359,640.61	0.05
308	688552	航天南湖	9,816	356,517.12	0.05
309	688128	中国电研	12,234	355,764.72	0.05
310	688165	埃夫特	14,966	355,592.16	0.05
311	688787	海天瑞声	3,030	351,449.70	0.05
312	688016	心脉医疗	3,781	346,566.46	0.05
313	688719	爱科赛博	7,686	339,336.90	0.05
314	688081	兴图新科	9,307	335,796.56	0.05
315	688083	中望软件	4,905	334,079.55	0.05
316	688232	新点软件	13,394	332,439.08	0.05
317	688488	艾迪药业	19,907	325,081.31	0.05
318	688716	中研股份	7,628	323,045.80	0.05

319	688229	博睿数据	5,152	322,927.36	0.05
320	688161	威高骨科	11,547	322,392.24	0.05
321	688531	日联科技	4,822	318,396.66	0.05
322	688788	科思科技	4,719	317,777.46	0.05
323	688112	鼎阳科技	8,475	317,388.75	0.05
324	688376	美埃科技	5,463	315,870.66	0.05
325	688150	莱特光电	11,673	315,521.19	0.05
326	688359	三孚新科	4,712	313,960.56	0.05
327	688328	深科达	10,567	308,345.06	0.05
328	688503	聚和材料	5,044	307,684.00	0.05
329	688222	成都先导	12,870	301,801.50	0.04
330	688102	斯瑞新材	7,774	301,164.76	0.04
331	688334	西高院	15,453	299,170.08	0.04
332	688586	江航装备	22,803	297,351.12	0.04
333	688261	东微半导	3,621	296,958.21	0.04
334	688345	博力威	9,502	296,462.40	0.04
335	688139	海尔生物	9,291	295,267.98	0.04
336	688262	国芯科技	9,718	294,941.30	0.04
337	688035	德邦科技	6,100	294,325.00	0.04
338	688401	路维光电	5,813	283,732.53	0.04
339	688115	思林杰	4,291	281,403.78	0.04
340	688125	安达智能	2,078	280,633.90	0.04
341	688028	沃尔德	4,327	279,264.58	0.04
342	688292	浩瀚深度	9,513	275,877.00	0.04
343	688308	欧科亿	8,538	270,142.32	0.04
344	688070	纵横股份	4,865	269,521.00	0.04
345	688750	金天钛业	13,422	268,037.34	0.04
346	688079	美迪凯	23,454	265,499.28	0.04
347	688665	四方光电	5,363	261,553.51	0.04
348	688283	坤恒顺维	6,362	256,388.60	0.04
349	688429	时创能源	19,475	254,927.75	0.04
350	688230	芯导科技	3,484	252,520.32	0.04
351	688209	英集芯	12,517	249,588.98	0.04
352	688558	国盛智科	8,472	245,094.96	0.04
353	688366	昊海生科	5,549	243,601.10	0.04
354	688383	新益昌	3,111	243,497.97	0.04
355	688007	光峰科技	13,088	243,044.16	0.04
356	688515	裕太微	2,344	240,377.20	0.04
357	688365	光云科技	13,950	235,336.50	0.03
358	688575	亚辉龙	16,434	233,362.80	0.03
359	688381	帝奥微	10,213	232,958.53	0.03
360	688595	芯海科技	7,086	232,420.80	0.03
361	688087	英科再生	7,523	231,858.86	0.03
362	688508	芯朋微	3,776	229,958.40	0.03

363	688620	安凯微	18,978	228,495.12	0.03
364	688448	磁谷科技	4,453	215,836.91	0.03
365	688046	药康生物	14,023	215,393.28	0.03
366	688377	迪威尔	5,861	215,098.70	0.03
367	688332	中科蓝讯	1,619	212,590.89	0.03
368	688598	金博股份	7,168	210,452.48	0.03
369	688265	南模生物	5,012	205,542.12	0.03
370	688526	科前生物	13,392	204,361.92	0.03
371	688657	浩辰软件	3,834	204,007.14	0.03
372	688573	信宇人	8,928	203,469.12	0.03
373	688151	华强科技	9,853	203,168.86	0.03
374	688622	禾信仪器	1,953	197,506.89	0.03
375	688221	前沿生物	10,805	195,030.25	0.03
376	688061	灿瑞科技	5,974	194,812.14	0.03
377	688133	泰坦科技	8,757	193,879.98	0.03
378	688236	春立医疗	8,427	192,809.76	0.03
379	688628	优利德	6,023	191,772.32	0.03
380	688176	亚虹医药	16,375	188,476.25	0.03
381	688689	银河微电	6,636	188,329.68	0.03
382	688227	品高股份	2,844	184,888.44	0.03
383	688231	隆达股份	7,109	184,834.00	0.03
384	688136	科兴制药	5,807	183,907.69	0.03
385	688357	建龙微纳	5,469	180,750.45	0.03
386	688119	中钢洛耐	32,320	180,668.80	0.03
387	688163	赛伦生物	8,103	176,402.31	0.03
388	688085	三友医疗	9,784	176,307.68	0.03
389	688566	吉贝尔	5,868	175,159.80	0.03
390	688170	德龙激光	5,555	174,760.30	0.03
391	688399	硕世生物	2,534	173,579.00	0.03
392	688391	钜泉科技	6,091	172,558.03	0.03
393	688611	杭州柯林	3,382	171,974.70	0.03
394	688090	瑞松科技	3,862	171,781.76	0.03
395	688623	双元科技	1,826	171,461.40	0.03
396	688181	八亿时空	5,298	171,231.36	0.03
397	688505	复旦张江	20,541	170,490.30	0.03
398	688293	奥浦迈	3,419	167,531.00	0.02
399	688601	力芯微	3,911	166,569.49	0.02
400	688419	耐科装备	5,943	166,344.57	0.02
401	688588	凌志软件	11,588	165,824.28	0.02
402	688157	松井股份	4,556	165,063.88	0.02
403	688767	博拓生物	4,360	164,720.80	0.02
404	688152	麒麟信安	4,025	162,408.75	0.02
405	688360	德马科技	7,547	160,449.22	0.02
406	688389	普门科技	12,354	160,354.92	0.02

407	688033	天宜新材	20,700	159,390.00	0.02
408	688080	映翰通	3,152	159,176.00	0.02
409	688246	嘉和美康	6,707	155,937.75	0.02
410	688339	亿华通	5,757	155,208.72	0.02
411	688570	天玛智控	8,421	155,114.82	0.02
412	688529	豪森智能	8,381	154,545.64	0.02
413	688571	杭华股份	20,253	150,884.85	0.02
414	688267	中触媒	5,309	149,554.53	0.02
415	688478	晶升股份	3,975	148,704.75	0.02
416	688653	康希通信	12,212	148,375.80	0.02
417	688480	赛恩斯	2,880	148,291.20	0.02
418	688512	慧智微	13,211	147,434.76	0.02
419	688560	明冠新材	10,174	145,386.46	0.02
420	688468	科美诊断	19,719	144,737.46	0.02
421	688683	莱尔科技	4,519	143,252.30	0.02
422	688207	格灵深瞳	9,221	140,159.20	0.02
423	688298	东方生物	5,834	136,690.62	0.02
424	688569	铁科轨道	6,213	136,499.61	0.02
425	688695	中创股份	4,903	134,489.29	0.02
426	688533	上声电子	4,595	134,357.80	0.02
427	688237	超卓航科	2,752	134,160.00	0.02
428	688610	埃科光电	2,165	133,818.65	0.02
429	688118	普元信息	5,185	132,321.20	0.02
430	688273	麦澜德	3,102	131,897.04	0.02
431	688203	海正生材	10,162	129,870.36	0.02
432	688602	康鹏科技	14,816	128,602.88	0.02
433	688117	圣诺生物	3,389	128,070.31	0.02
434	688162	巨一科技	3,998	123,138.40	0.02
435	688509	正元地信	22,004	120,801.96	0.02
436	688216	气派科技	5,407	120,467.96	0.02
437	688175	高凌信息	3,736	120,336.56	0.02
438	688171	纬德信息	2,573	120,056.18	0.02
439	688718	唯赛勃	9,112	119,184.96	0.02
440	688253	英诺特	3,944	119,029.92	0.02
441	688682	霍莱沃	2,229	117,936.39	0.02
442	688335	复洁科技	4,342	117,060.32	0.02
443	688302	海创药业	2,368	116,434.56	0.02
444	688501	青达环保	4,382	115,816.26	0.02
445	688089	嘉必优	4,922	114,584.16	0.02
446	688075	安旭生物	2,909	112,491.03	0.02
447	688516	奥特维	2,485	112,471.10	0.02
448	688317	之江生物	5,502	110,975.34	0.02
449	688517	金冠电气	7,023	109,488.57	0.02
450	688667	菱电电控	1,547	108,939.74	0.02

451	688613	奥精医疗	5,175	105,104.25	0.02
452	688679	通源环境	3,911	104,032.60	0.02
453	688358	祥生医疗	3,316	99,811.60	0.01
454	688260	昀冢科技	3,426	98,668.80	0.01
455	688576	西山科技	1,548	97,462.08	0.01
456	688592	司南导航	2,350	96,585.00	0.01
457	688551	科威尔	2,557	94,174.31	0.01
458	688285	高铁电气	10,785	93,613.80	0.01
459	688247	宣泰医药	9,426	91,432.20	0.01
460	688350	富淼科技	3,490	89,797.70	0.01
461	688459	哈铁科技	8,915	86,029.75	0.01
462	688132	邦彦技术	4,511	83,092.62	0.01
463	688244	永信至诚	3,351	81,898.44	0.01
464	688398	赛特新材	4,774	81,158.00	0.01
465	688045	必易微	2,054	79,469.26	0.01
466	688597	煜邦电力	9,600	78,816.00	0.01
467	688113	联测科技	1,983	78,387.99	0.01
468	688314	康拓医疗	2,274	75,178.44	0.01
469	688323	瑞华泰	3,337	75,115.87	0.01
470	688129	东来技术	3,705	74,952.15	0.01
471	688069	德林海	3,284	73,660.12	0.01
472	688737	中自科技	3,279	73,580.76	0.01
473	688121	卓然股份	6,683	72,978.36	0.01
474	688638	誉辰智能	1,894	68,809.02	0.01
475	688655	迅捷兴	4,007	68,639.91	0.01
476	688251	井松智能	2,309	67,884.60	0.01
477	688056	莱伯泰科	1,997	67,119.17	0.01
478	688355	明志科技	3,746	66,678.80	0.01
479	688026	洁特生物	4,116	66,308.76	0.01
480	688616	西力科技	5,230	63,962.90	0.01
481	688178	万德斯	2,592	62,285.76	0.01
482	688038	中科通达	3,492	61,703.64	0.01
483	688395	正弦电气	2,458	59,778.56	0.01
484	688479	友车科技	3,000	56,490.00	0.01
485	688681	科汇股份	3,114	54,744.12	0.01
486	688420	美腾科技	2,272	54,232.64	0.01
487	688450	光格科技	1,958	54,001.64	0.01
488	688096	京源环保	6,770	53,483.00	0.01
489	688528	秦川物联	4,925	53,042.25	0.01
490	688067	爱威科技	2,038	50,053.28	0.01
491	688329	艾隆科技	2,347	49,967.63	0.01
492	688565	力源科技	4,433	49,605.27	0.01
493	688021	奥福科技	2,378	43,636.30	0.01
494	688701	卓锦股份	3,888	31,687.20	0.00

495	688671	碧兴物联	940	23,283.80	0.00
496	688307	中润光学	331	14,302.51	0.00

## 8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300454	深信服	12,800	1,474,048.00	0.22
2	002240	盛新锂能	39,300	1,353,099.00	0.20
3	688795	摩尔线程	3,248	1,351,232.96	0.20
4	002192	融捷股份	23,700	1,226,475.00	0.18
5	300476	胜宏科技	4,200	1,207,836.00	0.18
6	300502	新易盛	2,600	1,120,288.00	0.16
7	300475	香农芯创	7,500	1,082,550.00	0.16
8	002837	英维克	8,900	951,321.00	0.14
9	002460	赣锋锂业	14,700	924,483.00	0.14
10	688802	沐曦股份	2,230	890,662.00	0.13
11	300443	金雷股份	31,600	888,908.00	0.13
12	300857	协创数据	5,200	877,136.00	0.13
13	300593	新雷能	28,900	860,064.00	0.13
14	002518	科士达	17,700	858,804.00	0.13
15	002922	伊戈尔	27,500	842,050.00	0.12
16	001309	德明利	3,500	811,615.00	0.12
17	300548	长芯博创	5,700	809,400.00	0.12
18	603286	日盈电子	11,500	795,340.00	0.12
19	002384	东山精密	9,000	761,850.00	0.11
20	002364	中恒电气	28,400	750,896.00	0.11
21	600183	生益科技	10,100	721,241.00	0.11
22	603083	剑桥科技	5,300	712,214.00	0.10
23	300870	欧陆通	3,200	707,200.00	0.10
24	002916	深南电路	3,030	703,838.70	0.10
25	300223	北京君正	6,600	699,864.00	0.10
26	001301	尚太科技	8,100	695,061.00	0.10
27	603881	数据港	22,720	691,369.60	0.10
28	605060	联德股份	18,400	680,064.00	0.10
29	301171	易点天下	16,700	676,350.00	0.10
30	002487	大金重工	12,800	664,704.00	0.10
31	300285	国瓷材料	24,100	660,581.00	0.10
32	300990	同飞股份	7,280	656,292.00	0.10
33	002466	天齐锂业	11,800	653,484.00	0.10
34	300913	兆龙互连	12,100	636,823.00	0.09
35	300568	星源材质	41,200	628,300.00	0.09
36	603191	望变电气	41,500	614,615.00	0.09

37	300980	祥源新材	18,600	606,918.00	0.09
38	300409	道氏技术	26,800	602,732.00	0.09
39	300693	盛弘股份	15,700	600,996.00	0.09
40	000988	华工科技	7,500	594,975.00	0.09
41	300438	鹏辉能源	11,000	585,420.00	0.09
42	002536	飞龙股份	19,200	570,240.00	0.08
43	002850	科达利	3,600	568,296.00	0.08
44	002130	沃尔核材	21,500	565,880.00	0.08
45	300442	润泽科技	10,600	559,680.00	0.08
46	002270	华明装备	22,000	550,880.00	0.08
47	300035	中科电气	25,400	540,766.00	0.08
48	002851	麦格米特	6,000	540,420.00	0.08
49	002654	万润科技	38,100	536,067.00	0.08
50	002595	豪迈科技	6,300	532,413.00	0.08
51	002407	多氟多	15,400	522,214.00	0.08
52	600592	龙溪股份	19,100	521,621.00	0.08
53	300850	新强联	12,600	521,262.00	0.08
54	300602	飞荣达	15,700	520,612.00	0.08
55	300919	中伟股份	11,200	518,896.00	0.08
56	003033	征和工业	6,500	510,965.00	0.08
57	300047	天源迪科	40,400	507,020.00	0.07
58	300042	朗科科技	19,700	506,290.00	0.07
59	002335	科华数据	9,100	505,323.00	0.07
60	600577	精达股份	40,400	502,172.00	0.07
61	301018	申菱环境	7,900	501,808.00	0.07
62	002829	星网宇达	15,900	499,578.00	0.07
63	002156	通富微电	13,200	497,640.00	0.07
64	300738	奥飞数据	26,900	497,381.00	0.07
65	002340	格林美	59,200	494,912.00	0.07
66	300457	赢合科技	17,600	490,160.00	0.07
67	002533	金杯电工	39,200	489,216.00	0.07
68	003019	宸展光电	14,500	485,460.00	0.07
69	300570	太辰光	4,200	485,310.00	0.07
70	300819	聚杰微纤	14,000	483,980.00	0.07
71	002979	雷赛智能	11,400	479,598.00	0.07
72	300207	欣旺达	18,300	478,545.00	0.07
73	002706	良信股份	44,300	477,554.00	0.07
74	002131	利欧股份	83,800	472,632.00	0.07
75	301012	扬电科技	17,700	468,165.00	0.07
76	688783	西安奕材	25,143	462,379.77	0.07
77	300014	亿纬锂能	7,000	460,320.00	0.07
78	605277	新亚电子	20,500	451,000.00	0.07
79	603228	景旺电子	6,100	445,849.00	0.07
80	301160	翔楼新材	6,050	434,934.50	0.06

81	301155	海力风电	5,300	428,929.00	0.06
82	000917	电广传媒	41,700	428,676.00	0.06
83	300679	电连技术	8,700	423,516.00	0.06
84	300660	江苏雷利	7,680	421,017.60	0.06
85	600458	时代新材	31,600	419,332.00	0.06
86	002733	雄韬股份	21,300	418,119.00	0.06
87	300846	首都在线	18,300	417,789.00	0.06
88	603063	禾望电气	12,300	406,761.00	0.06
89	605068	明新旭腾	15,700	401,449.00	0.06
90	603278	大业股份	23,400	398,736.00	0.06
91	300918	南山智尚	21,400	397,826.00	0.06
92	003021	兆威机电	3,200	397,376.00	0.06
93	002920	德赛西威	3,300	396,990.00	0.06
94	300757	罗博特科	1,700	396,610.00	0.06
95	300073	当升科技	6,800	393,040.00	0.06
96	300952	恒辉安防	9,500	388,265.00	0.06
97	605488	福莱新材	11,260	386,781.00	0.06
98	301291	明阳电气	9,200	382,812.00	0.06
99	301000	肇民科技	9,600	377,952.00	0.06
100	002896	中大力德	4,220	377,099.20	0.06
101	002324	普利特	23,500	375,765.00	0.06
102	002709	天赐材料	8,100	375,273.00	0.06
103	603662	柯力传感	5,100	367,200.00	0.05
104	000977	浪潮信息	5,500	366,300.00	0.05
105	300007	汉威科技	6,800	364,480.00	0.05
106	300969	恒帅股份	2,900	358,730.00	0.05
107	300953	震裕科技	2,100	352,842.00	0.05
108	001267	汇绿生态	16,100	352,590.00	0.05
109	000700	模塑科技	24,500	352,310.00	0.05
110	002463	沪电股份	4,800	350,736.00	0.05
111	301358	湖南裕能	5,400	349,164.00	0.05
112	603920	世运电路	7,200	348,552.00	0.05
113	300170	汉得信息	18,400	348,128.00	0.05
114	605133	嵘泰股份	9,870	338,442.30	0.05
115	603985	恒润股份	22,200	338,328.00	0.05
116	002400	省广集团	37,600	333,512.00	0.05
117	001288	运机集团	10,300	329,085.00	0.05
118	300852	四会富仕	8,600	328,348.00	0.05
119	300984	金沃股份	3,800	322,544.00	0.05
120	301196	唯科科技	4,000	322,280.00	0.05
121	600480	凌云股份	26,220	322,243.80	0.05
122	603659	璞泰来	11,700	319,878.00	0.05
123	603901	永创智能	22,500	319,500.00	0.05
124	301308	江波龙	1,300	318,292.00	0.05

125	300863	卡倍亿	6,300	317,520.00	0.05
126	603130	云中马	5,600	317,240.00	0.05
127	688759	必贝特	12,552	315,431.76	0.05
128	002112	三变科技	23,500	311,610.00	0.05
129	301361	众智科技	9,500	309,605.00	0.05
130	605228	神通科技	20,600	307,558.00	0.05
131	603166	福达股份	19,000	298,300.00	0.04
132	300413	芒果超媒	12,200	297,924.00	0.04
133	301225	恒勃股份	1,800	297,900.00	0.04
134	600986	浙文互联	37,500	293,250.00	0.04
135	300001	特锐德	11,300	290,184.00	0.04
136	601858	中国科传	15,800	286,770.00	0.04
137	600835	上海机电	9,500	285,095.00	0.04
138	600633	浙数文化	22,100	284,206.00	0.04
139	603809	豪能股份	19,600	281,260.00	0.04
140	002292	奥飞娱乐	31,400	277,890.00	0.04
141	605589	圣泉集团	9,800	277,340.00	0.04
142	002315	焦点科技	6,000	274,560.00	0.04
143	002757	南兴股份	14,000	272,580.00	0.04
144	688790	昂瑞微	2,319	271,485.33	0.04
145	300809	华辰装备	7,100	270,297.00	0.04
146	605168	三人行	7,000	270,060.00	0.04
147	600143	金发科技	13,700	267,698.00	0.04
148	600673	东阳光	11,800	264,674.00	0.04
149	002995	天地在线	15,500	256,060.00	0.04
150	301210	金杨精密	7,000	254,800.00	0.04
151	300433	蓝思科技	8,400	254,268.00	0.04
152	301255	通力科技	8,600	251,550.00	0.04
153	301510	固高科技	6,600	247,170.00	0.04
154	601689	拓普集团	3,200	246,976.00	0.04
155	300382	斯莱克	15,800	245,848.00	0.04
156	000338	潍柴动力	14,100	242,520.00	0.04
157	301550	斯菱智驱	1,740	241,338.00	0.04
158	300395	菲利华	2,400	240,720.00	0.04
159	002276	万马股份	14,200	240,122.00	0.04
160	605555	德昌股份	12,930	236,619.00	0.03
161	001339	智微智能	4,600	235,106.00	0.03
162	002380	科远智慧	8,600	233,920.00	0.03
163	300491	通合科技	9,300	233,709.00	0.03
164	301596	瑞迪智驱	2,960	232,715.20	0.03
165	300302	同有科技	12,800	232,192.00	0.03
166	001306	夏厦精密	2,600	231,400.00	0.03
167	300549	优德精密	12,200	230,092.00	0.03
168	002527	新时达	12,800	227,072.00	0.03

169	001282	三联锻造	10,540	224,712.80	0.03
170	002747	埃斯顿	9,400	222,780.00	0.03
171	002484	江海股份	7,500	222,750.00	0.03
172	603171	税友股份	4,000	220,520.00	0.03
173	002801	微光股份	6,200	219,542.00	0.03
174	300624	万兴科技	3,100	219,015.00	0.03
175	002031	巨轮智能	27,700	217,722.00	0.03
176	603270	金帝股份	8,000	216,240.00	0.03
177	301368	丰立智能	3,400	213,078.00	0.03
178	300580	贝斯特	8,000	210,320.00	0.03
179	603666	亿嘉和	7,000	207,900.00	0.03
180	300607	拓斯达	6,300	207,522.00	0.03
181	300083	创世纪	22,300	205,383.00	0.03
182	002915	中欣氟材	8,300	203,350.00	0.03
183	301007	德迈仕	4,800	194,496.00	0.03
184	603855	华荣股份	9,900	191,565.00	0.03
185	603375	盛景微	5,200	189,800.00	0.03
186	300634	彩讯股份	7,500	189,225.00	0.03
187	002050	三花智控	3,400	188,054.00	0.03
188	603039	泛微网络	3,500	187,390.00	0.03
189	002520	日发精机	29,600	186,480.00	0.03
190	00013	和黄医药	10,000	186,243.96	0.03
191	300996	普联软件	11,200	185,248.00	0.03
192	603119	浙江荣泰	1,600	185,072.00	0.03
193	301261	恒工精密	1,800	184,644.00	0.03
194	301003	江苏博云	4,100	182,860.00	0.03
195	301397	溯联股份	5,210	181,464.30	0.03
196	600580	卧龙电驱	3,660	179,706.00	0.03
197	000938	紫光股份	7,100	174,660.00	0.03
198	300803	指南针	1,300	170,131.00	0.03
199	300037	新宙邦	3,200	167,680.00	0.02
200	300378	鼎捷数智	3,700	167,462.00	0.02
201	301396	宏景科技	2,500	165,750.00	0.02
202	688583	思看科技	1,693	157,770.67	0.02
203	002698	博实股份	9,000	151,290.00	0.02
204	300353	东土科技	7,400	150,664.00	0.02
205	301310	鑫宏业	3,500	150,325.00	0.02
206	300450	先导智能	3,000	149,940.00	0.02
207	301413	安培龙	1,100	148,280.00	0.02
208	300657	弘信电子	5,300	146,598.00	0.02
209	300418	昆仑万维	3,500	145,950.00	0.02
210	603026	石大胜华	1,900	142,139.00	0.02
211	600640	国脉文化	11,200	140,672.00	0.02
212	300648	星云股份	2,600	134,108.00	0.02

213	301128	强瑞技术	1,300	131,183.00	0.02
214	301076	新瀚新材	2,640	130,178.40	0.02
215	002123	梦网科技	10,700	130,112.00	0.02
216	603150	万朗磁塑	3,400	129,132.00	0.02
217	603275	众辰科技	2,800	127,624.00	0.02
218	002645	华宏科技	8,400	122,976.00	0.02
219	300654	世纪天鸿	12,400	122,884.00	0.02
220	301022	海泰科	3,700	122,433.00	0.02
221	002765	蓝黛科技	9,100	121,667.00	0.02
222	300695	兆丰股份	1,200	120,072.00	0.02
223	603344	星德胜	3,200	119,552.00	0.02
224	002048	宁波华翔	3,800	119,548.00	0.02
225	603013	亚普股份	4,800	118,416.00	0.02
226	300403	汉宇集团	8,100	116,721.00	0.02
227	300611	美力科技	4,200	114,492.00	0.02
228	002472	双环传动	2,300	109,043.00	0.02
229	002600	领益智造	6,900	107,226.00	0.02
230	300390	天华新能	1,900	103,759.00	0.02
231	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.02
232	002664	信质集团	4,300	103,028.00	0.02
233	300751	迈为股份	500	102,995.00	0.02
234	301013	利和兴	3,600	100,836.00	0.01
235	300724	捷佳伟创	1,000	95,600.00	0.01
236	300926	博俊科技	2,900	95,062.00	0.01
237	301236	软通动力	2,000	94,860.00	0.01
238	603730	岱美股份	10,800	94,608.00	0.01
239	603081	大丰实业	6,600	92,598.00	0.01
240	000887	中鼎股份	3,900	90,519.00	0.01
241	603305	旭升集团	5,400	87,372.00	0.01
242	603489	八方股份	2,800	85,624.00	0.01
243	605128	上海沿浦	2,300	84,778.00	0.01
244	300666	江丰电子	900	82,800.00	0.01
245	600184	光电股份	4,300	81,958.00	0.01
246	605333	沪光股份	2,700	80,541.00	0.01
247	301313	凡拓数创	3,000	79,530.00	0.01
248	605208	永茂泰	5,700	77,406.00	0.01
249	300054	鼎龙股份	2,000	75,200.00	0.01
250	301268	铭利达	4,100	74,743.00	0.01
251	603000	人民网	3,900	74,295.00	0.01
252	300432	富临精工	4,240	70,808.00	0.01
253	600967	内蒙一机	4,200	70,560.00	0.01
254	300316	晶盛机电	1,900	69,825.00	0.01
255	301325	曼恩斯特	1,300	65,715.00	0.01
256	600588	用友网络	4,900	64,974.00	0.01

257	300748	金力永磁	1,900	64,809.00	0.01
258	300627	华测导航	1,800	62,838.00	0.01
259	002892	科力尔	4,640	62,268.80	0.01
260	300487	蓝晓科技	1,000	61,750.00	0.01
261	600536	中国软件	1,300	60,190.00	0.01
262	600764	中国海防	2,100	57,414.00	0.01
263	300763	锦浪科技	800	57,128.00	0.01
264	688729	屹唐股份	2,099	50,963.72	0.01
265	688809	强一股份	242	49,201.02	0.01
266	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
267	300735	光弘科技	1,300	32,318.00	0.00
268	001386	马可波罗	1,564	28,980.92	0.00
269	301165	锐捷网络	300	26,640.00	0.00
270	600549	厦门钨业	500	20,530.00	0.00
271	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
272	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
273	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
274	301377	鼎泰高科	100	13,910.00	0.00
275	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
276	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
277	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
278	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
279	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
280	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
281	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
282	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
283	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
284	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
285	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
286	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
287	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
288	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪	59,067,538.56	8.70
2	688041	海光信息	56,744,219.87	8.35
3	688981	中芯国际	33,223,141.41	4.89

4	688111	金山办公	21,021,273.60	3.09
5	688008	澜起科技	18,849,195.48	2.78
6	688012	中微公司	17,522,620.88	2.58
7	688506	百利天恒	13,969,415.57	2.06
8	688271	联影医疗	12,553,683.06	1.85
9	688036	传音控股	11,406,935.41	1.68
10	688775	影石创新	10,319,700.47	1.52
11	688521	芯原股份	9,338,945.45	1.37
12	688223	晶科能源	8,820,288.40	1.30
13	688126	沪硅产业	8,735,860.08	1.29
14	688303	大全能源	8,396,369.08	1.24
15	688047	龙芯中科	7,832,877.96	1.15
16	688608	恒玄科技	7,763,637.48	1.14
17	688396	华润微	7,696,525.29	1.13
18	688072	拓荆科技	7,296,470.74	1.07
19	688249	晶合集成	7,107,036.44	1.05
20	688183	生益电子	7,068,328.02	1.04

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪	32,612,198.05	4.80
2	688041	海光信息	28,396,214.55	4.18
3	688981	中芯国际	16,108,260.68	2.37
4	688111	金山办公	11,991,195.94	1.77
5	688008	澜起科技	9,603,172.86	1.41
6	688271	联影医疗	8,822,774.66	1.30
7	688506	百利天恒	8,513,717.35	1.25
8	688012	中微公司	8,336,902.68	1.23
9	688036	传音控股	8,133,580.23	1.20
10	688047	龙芯中科	6,250,336.22	0.92
11	688396	华润微	5,770,912.52	0.85
12	688072	拓荆科技	5,539,368.23	0.82
13	688538	和辉光电	5,367,807.23	0.79
14	688126	沪硅产业	5,250,766.45	0.77
15	688183	生益电子	4,981,775.10	0.73
16	688223	晶科能源	4,854,074.91	0.71
17	688249	晶合集成	4,771,351.69	0.70
18	688082	盛美上海	4,629,146.65	0.68

19	688122	西部超导	4,531,910.02	0.67
20	688349	三一重能	4,387,700.50	0.65

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。

#### 8.4.3 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	1,486,925,408.82
卖出股票收入（成交）总额	987,856,502.94

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。

#### 8.5 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）	96,706.51	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,706.51	0.01

#### 8.6 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	118063	金 05 转债	780	78,001.03	0.01
2	123263	鼎捷转债	129	18,705.48	0.00

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 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	4,076,165.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,076,165.36
---	----	--------------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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	688012	中微公司	12,469,677.50	1.84	重大事项停牌

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	1,351,232.96	0.20	新股流通受限

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	12,307	8,616.16	93,317.81	0.09%	105,945,823.77	99.91%
易方达上证科创板综合增强 C	22,293	16,940.23	1,921,285.34	0.51%	375,727,208.63	99.49%
合计	34,600	13,979.41	2,014,603.15	0.42%	481,673,032.40	99.58%

### 9.2 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	12,095.00	0.0114%
	易方达上证科创板综合增强 C	222,306.85	0.0589%
	合计	234,401.85	0.0485%

### 9.3 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

## § 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	203,749,481.54	1,116,946,681.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	252,697,858.27	1,166,554,090.48
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	106,039,141.58	377,648,493.97

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

2025 年 11 月 5 日，根据我司工作安排，黄伟先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）职务，聘任宋菁女士为平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 55,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金

	监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。
其他	/

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	3	2,471,311,278.21	100.00%	238,336.03	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) 上交所 A 股普通交易佣金率为 0.015%（包含经手费、证管费），深交所 A 股普通交易佣金率为 0.016%（包含经手费、证管费和过户费），北交所股票交易佣金率为 0.022%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.015%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，债券、回购交易佣金率为 0，可转债佣金率为 0.004%。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，本年度内选择标准有调整，调整后的标准如下：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
平安证券	181,660.03	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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	易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	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	2025-04-30
2	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	2025-05-17
3	易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和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	2025-05-27
4	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
5	关于易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-16
6	关于旗下部分基金 2025 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性	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	2025-06-26

	公告		
7	易方达基金管理有限公司关于设立易方达财富管理基金销售（广州）有限公司的公告	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	2025-07-03
8	易方达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	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	2025-07-10
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2025-07-21
10	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-29
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	证券时报	2025-08-30
12	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-04
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-05
14	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	2025-09-30
15	关于旗下部分基金 2025 年 10 月 29 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-24
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报	2025-10-28
17	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	2025-11-28
18	关于旗下部分基金 2025 年 12 月 24 日至 2025 年 12 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-19
19	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	2025-12-19
20	关于易方达财富管理基金销售（广州）有限公司展业及易方达基金管理有限公司零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合公告	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	2025-12-23
21	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金	2025-12-25

		电子披露网站	
22	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	2025-12-25
23	关于旗下部分基金 2025 年 12 月 31 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-26

## § 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

二〇二六年三月三十一日