# 银华中证A500指数增强型证券投资基金
# 2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026年8月29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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 8**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
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 ..... 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
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 ..... 13

**§5 托管人报告 ..... 13**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
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 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 14

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 14**

6.1 资产负债表 ..... 14
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 18

**§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 ..... 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 58
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 ..... 58

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 ..... 58
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 ..... 58
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 ..... 58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 58
7.12 投资组合报告附注 ..... 58

**§8 基金份额持有人信息 ..... 59**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 60

**§9 开放式基金份额变动 ..... 60**

**§10 重大事件揭示 ..... 60**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 60
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 ..... 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 61
10.4 基金投资策略的改变 ..... 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 61
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 ..... 61
10.8 其他重大事件 ..... 62

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 63**

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 ..... 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 63

**§12 备查文件目录 ..... 63**

12.1 备查文件目录 ..... 63
12.2 存放地点 ..... 63
12.3 查阅方式 ..... 63

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 银华中证 A500 指数增强型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 银华中证 A500 指数增强 | |
| 基金主代码 | 023932 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2025 年 9 月 16 日 | |
| 基金管理人 | 银华基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 420,113,121.29 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 银华中证 A500 指数增强 A | 银华中证 A500 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 023932 | 023933 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 183,234,695.18 份 | 236,878,426.11 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用指数增强投资策略，力求控制本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 0.50%，年跟踪误差不超过 7.75%；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，谋求基金资产的长期增值。<br>本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例不低于 80%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 |
| 业绩比较基准 | 中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金为指数型基金，主要采用指数增强投资策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。<br>本基金若投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基 |

| | |
|---|---|
| | 金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。 |

## 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 | | 银华基金管理股份有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨文辉 | 张姗 |
| | 联系电话 | (010)58163000 | 400-61-95555 |
| | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 4006783333,(010)85186558 | 400-61-95555 |
| 传真 | | (010)58163027 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 100738 | 518040 |
| 法定代表人 | | 王珠林 | 缪建民 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | http://www.yhfund.com.cn |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 银华基金管理股份有限公司 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 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 - 2026 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 银华中证 A500 指数增强 A | 银华中证 A500 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | 30,715,405.85 | 39,090,781.45 |
| 本期利润 | 32,901,248.43 | 42,874,870.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1240 | 0.1260 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.57% | 11.77% |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.57% | 11.34% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |

| | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 20,709,787.20 | 25,933,278.03 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1130 | 0.1095 |
| 期末基金资产净值 | 208,130,158.42 | 268,214,101.07 |
| 期末基金份额净值 | 1.1359 | 1.1323 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 13.59% | 13.23% |

注：1、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。2、期末可供分配利润，采用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、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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

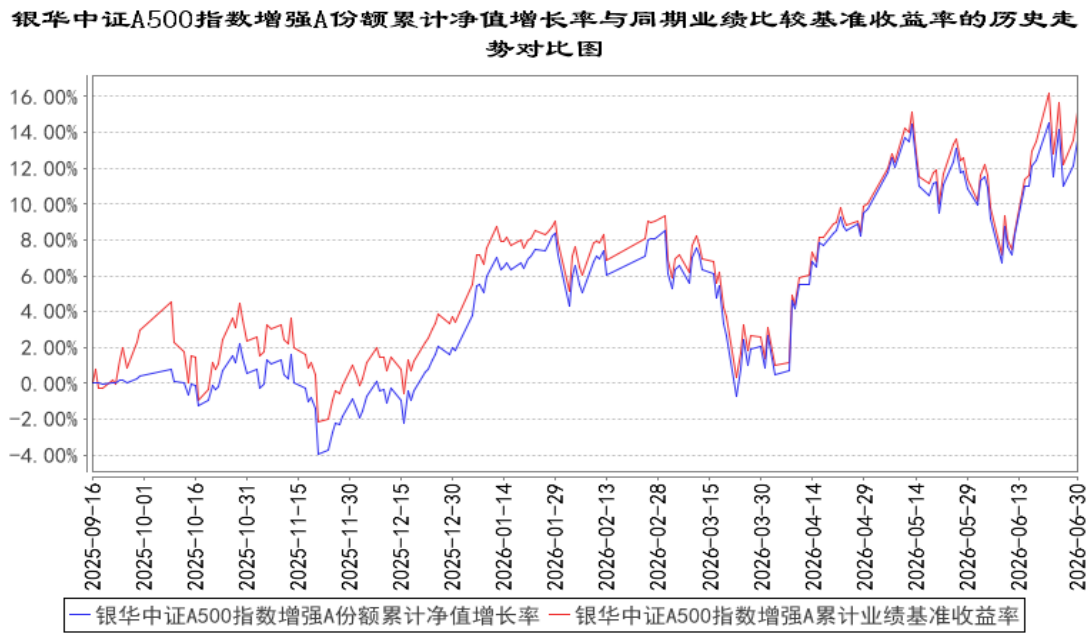
银华中证 A500 指数增强 A

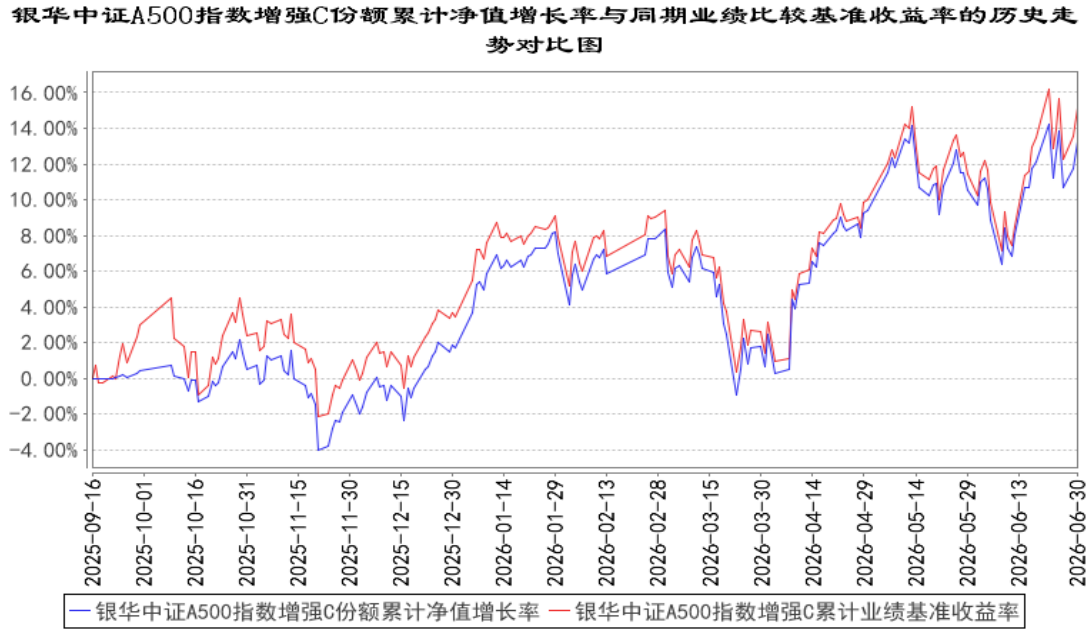
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 12.64% | 1.26% | 13.54% | 1.34% | -0.90% | -0.08% |
| 过去六个月 | 11.57% | 1.18% | 11.34% | 1.22% | 0.23% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.59% | 1.04% | 15.14% | 1.13% | -1.55% | -0.09% |

银华中证 A500 指数增强 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 | 12.53% | 1.26% | 13.54% | 1.34% | -1.01% | -0.08% |
| 过去六个月 | 11.34% | 1.18% | 11.34% | 1.22% | 0.00% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.23% | 1.04% | 15.14% | 1.13% | -1.91% | -0.09% |

### 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




注：本基金合同生效日期为 2025 年 09 月 16 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、

综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2026 年 6 月底，银华基金管理公募基金 255 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续六年实现运营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

### 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 | | |
| 杨腾先生 | 本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 16 日 | - | 13.5 年 | 硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理/投资经理助理（社保、基本养老）。自 2021 年 11 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 11 月 29 日至 2023 年 3 月 16 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 3 月 7 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 9 月 16 日起兼任银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 张凯先生 | 本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 16 日 | - | 16.5 年 | 硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监/中心负责人/投资经理助理（社保、基本养老）/基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 17 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 26 日至 2022 年 7 月 28 日兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2020 年 11 月 30 日起兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 2 月 23 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 5 月 13 日至 2022 年 6 月 17 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 19 日至 2025 年 4 月 28 日兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 8 月 20 日起兼任银华上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 9 月 16 日起兼任银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2026 年 3 月 18 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 张卓希女士 | 本基金的基金经理助理 | 2025 年 10 月 22 日 | - | 9.5 年 | 硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永（中国）企业咨询有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 郭九良先生 | 本基金的基金经理助理 | 2025 年 10 月 30 日 | - | 7 年 | 硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理股份有限公司，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况。

## 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

上半年中，国内宏观调控政策持续发力，内需修复进程延续推进。消费品以旧换新补贴等政策持续实施，春节、清明、五一等多轮假期配套各地线下促消费专项活动，居民出行、终端商品消费景气度呈现企稳回升。依托海外出口需求韧性与国内稳内需政策双向支撑，制造业 PMI 连续多月运行于扩张区间，生产端与需求端同步实现边际改善。海外方面，中东地缘冲突反复扰动大宗商品，原油高位震荡，黄金冲高回落；美国通胀数据波动扩大，美联储上半年维持高基准利率不变，持续释放货币政策中长期偏紧信号，美元指数整体保持强势，新兴市场持续面临资本外流、本币汇率承压的双重压力。在上述因素的作用下，A 股市场在上半年呈现典型的结构性行情。行业层面，电子、通信、建材等行业表现领先，消费者服务、农林牧渔、商贸零售等行业表现落后。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.1359 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.57%；截至本报告期末银华中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1323 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.34%；业绩比较基准收益率为 11.34%。

### 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，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，内需的恢复进程、海外地缘冲突等指标将是边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，

并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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：银华中证A500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 35,036,733.16 | 81,390,337.23 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 443,500,176.38 | 848,678,884.63 |
| 其中：股票投资 | | 443,500,176.38 | 848,678,884.63 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 332,865.69 | 586,009.95 |
| 递延所得税资产 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 478,869,775.23 | 930,655,231.81 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 1,943,972.84 | 24,149,037.48 |
| 应付管理人报酬 | | 319,101.52 | 648,530.90 |
| 应付托管费 | | 59,831.52 | 121,599.55 |
| 应付销售服务费 | | 90,555.26 | 189,550.55 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 112,054.60 | 43,096.37 |
| 负债合计 | | 2,525,515.74 | 25,151,814.85 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 420,113,121.29 | 889,961,087.77 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 56,231,138.20 | 15,542,329.19 |
| 净资产合计 | | 476,344,259.49 | 905,503,416.96 |
| 负债和净资产总计 | | 478,869,775.23 | 930,655,231.81 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，银华中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.1359 元，基金份额总额 183,234,695.18 份；银华中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.1323 元，基金份额总额 236,878,426.11 份。银华中证 A500 指数增强份额总额合计为 420,113,121.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 79,683,255.22 |
| 1.利息收入 | | 42,938.83 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 42,938.83 |
| 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） | | 73,662,335.42 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 69,205,319.70 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 4,457,015.72 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 5,969,931.52 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 8,049.45 |
| **减：二、营业总支出** | | 3,907,136.40 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,591,745.08 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 485,952.18 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 727,573.09 |
| 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 | 6.4.7.22 | - |
| 7．税金及附加 | | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.23 | 101,866.05 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 75,776,118.82 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 75,776,118.82 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - |
| **六、综合收益总额** | | 75,776,118.82 |

注：本基金合同生效日为2025年09月16日，无上年度可比期间数据。

## 6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 一、上期期末净资产 | 889,961,087.77 | - | 15,542,329.19 | 905,503,416.96 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 889,961,087.77 | - | 15,542,329.19 | 905,503,416.96 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -469,847,966.48 | - | 40,688,809.01 | -429,159,157.47 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 75,776,118.82 | 75,776,118.82 |
| （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） | -469,847,966.48 | - | -35,087,309.81 | -504,935,276.29 |
| 其中：1.基金申购款 | 40,259,504.68 | - | 2,635,796.28 | 42,895,300.96 |
| 2.基金赎回款 | -510,107,471.16 | - | -37,723,106.09 | -547,830,577.25 |
| （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）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 420,113,121.29 | - | 56,231,138.20 | 476,344,259.49 |

注：本基金合同生效日为2025年09月16日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

| 王立新 | 凌宇翔 | 伍军辉 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华中证 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经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]593 号《关于准予银华中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,140,290,174.67 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,140,516,913.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 226,738.37 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取的认购/申购费用与销售服务费用方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。同时，为更好地实现投资目标，本基金可投资于部分非成份股(包括主板股票、创业板股票、科创板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、衍生工具(股指期货、股票期权、国债期货)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例不低于 80%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金

资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

### 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务

总局证监会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》、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、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》、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、税务总局公告2026年第10号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。2027年12月31日前，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%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上

市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 18,554,262.79 |
| 等于：本金 | 18,552,452.85 |
| 加：应计利息 | 1,809.94 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | 16,482,470.37 |
| 等于：本金 | 16,482,156.50 |
| 加：应计利息 | 313.87 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 35,036,733.16 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 417,393,013.19 | - | 443,500,176.38 | 26,107,163.19 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 417,393,013.19 | - | 443,500,176.38 | 26,107,163.19 |

### 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

注：无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

### 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

注：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 无。 |

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

### 6.4.7.8 其他资产

注：无。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 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 | 91,739.85 |
| 其他 | 20,314.75 |
| 合计 | 112,054.60 |

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华中证 A500 指数增强 A

| 项目 | 本期<br>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 | 376,184,644.76 | 376,184,644.76 |
| 本期申购 | 9,875,282.78 | 9,875,282.78 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -202,825,232.36 | -202,825,232.36 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 183,234,695.18 | 183,234,695.18 |

银华中证 A500 指数增强 C

| 项目 | 本期<br>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 | 513,776,443.01 | 513,776,443.01 |
| 本期申购 | 30,384,221.90 | 30,384,221.90 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -307,282,238.80 | -307,282,238.80 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 236,878,426.11 | 236,878,426.11 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华中证 A500 指数增强 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | -749,761.97 | 7,576,232.20 | 6,826,470.23 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -749,761.97 | 7,576,232.20 | 6,826,470.23 |
| 本期利润 | 30,715,405.85 | 2,185,842.58 | 32,901,248.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,255,856.68 | -5,576,398.74 | -14,832,255.42 |
| 其中：基金申购款 | 462,850.18 | 241,645.42 | 704,495.60 |
| 基金赎回款 | -9,718,706.86 | -5,818,044.16 | -15,536,751.02 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 20,709,787.20 | 4,185,676.04 | 24,895,463.24 |

银华中证 A500 指数增强 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | -1,619,427.68 | 10,335,286.64 | 8,715,858.96 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -1,619,427.68 | 10,335,286.64 | 8,715,858.96 |
| 本期利润 | 39,090,781.45 | 3,784,088.94 | 42,874,870.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -11,538,075.74 | -8,716,978.65 | -20,255,054.39 |
| 其中：基金申购款 | 1,433,764.89 | 497,535.79 | 1,931,300.68 |
| 基金赎回款 | -12,971,840.63 | -9,214,514.44 | -22,186,355.07 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 25,933,278.03 | 5,402,396.93 | 31,335,674.96 |

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 35,281.34 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 7,585.82 |
| 结算备付金利息收入 | - |

| | |
|---|---|
| 其他 | 71.67 |
| 合计 | 42,938.83 |

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 | 69,205,319.70 |
| 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 | 69,205,319.70 |

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 1,460,544,472.68 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,390,096,923.73 |
| 减：交易费用 | 1,242,229.25 |
| 买卖股票差价收入 | 69,205,319.70 |

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

### 6.4.7.15 债券投资收益

#### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,457,015.72 |
| 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 | 4,457,015.72 |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 5,969,931.52 |
| 股票投资 | 5,969,931.52 |

| | |
|---|---|
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 5,969,931.52 |

### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 7,447.98 |
| 基金转换费收入 | 601.47 |
| 合计 | 8,049.45 |

### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 审计费用 | 32,232.48 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 9,702.21 |
| 其他 | 423.99 |
| 合计 | 101,866.05 |

### 6.4.7.24 分部报告

无。

## 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

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 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

无。

#### 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 |
| --- | --- |
| 银华基金管理股份有限公司（“银华基金”） | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人 |

注：下述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

注：无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,591,745.08 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,251,578.60 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,340,166.48 |

注：本基金管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值 × 0.80%/ 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 485,952.18 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.15%/ 当年天数。

#### 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<br>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 | | |
| | 银华中证 A500 指数增强 A | 银华中证 A500 指数增强 C | 合计 |
| 银华基金 | - | 534.44 | 534.44 |
| 招商银行 | - | 680,088.13 | 680,088.13 |
| 合计 | - | 680,622.57 | 680,622.57 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给银华基金，再由银华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40%/ 当年天数。

### 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

注：无。

### 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

注：无。

#### 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

注：无。

### 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

注：无。

#### 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

注：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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 18,554,262.79 | 35,281.34 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按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

注：无。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

### 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 年 1 月 27 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 28.00 | 27.78 | 57 | 1,596.00 | 1,583.46 | - |
| 001237 | 惠康科技 | 2026 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 53.26 | 58.74 | 274 | 14,593.24 | 16,094.76 | - |
| 001248 | 华润新 | 2026 年 6 月 24 | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11 | 14,797 | 149,597.67 | 149,597.67 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 能源 | 日 | | | | | | | | |
| 001248 | 华润新能源 | 2026年6月24日 | 1个月内（含） | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11 | 6,341 | 64,107.51 | 64,107.51 | - |
| 001257 | 盛龙股份 | 2026年3月24日 | 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年4月14日 | 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年5月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 27.19 | 31.31 | 657 | 17,863.83 | 20,570.67 | - |
| 001393 | 维通利 | 2026年5月8日 | 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年6月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.12 | 27.73 | 2,511 | 25,411.32 | 69,630.03 | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026年4月28日 | 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年4月22日 | 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年4月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.08 | 463.33 | 976 | 44,974.08 | 452,210.08 | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026年6月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.08 | 28.40 | 546 | 3,865.68 | 15,506.40 | - |
| 301680 | 固 | 2026 | 6个月 | 新股 | 58.00 | 112.16 | 117 | 6,786.00 | 13,122.72 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 德电材 | 年2月27日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301682 | 宏明电子 | 2026年3月18日 | 6个月 | 新股流通受限 | 69.66 | 160.06 | 615 | 42,840.90 | 98,436.90 | - |
| 301683 | 慧谷新材 | 2026年3月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 78.38 | 121.77 | 96 | 7,524.48 | 11,689.92 | - |
| 301687 | 新广益 | 2025年12月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.93 | 77.78 | 195 | 4,276.35 | 15,167.10 | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.68 | 86.80 | 216 | 5,330.88 | 18,748.80 | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026年1月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 17.59 | 742 | 8,295.56 | 13,051.78 | - |
| 603284 | 林平发展 | 2026年2月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.88 | 34.87 | 46 | 1,742.48 | 1,604.02 | - |
| 603293 | 埃泰克 | 2026年4月9日 | 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年5月15日 | 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年3月31日 | 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年5月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 40.98 | 308.19 | 128 | 5,245.44 | 39,448.32 | - |
| 688712 | 北 | 2026 | 6个月 | 新股 | 17.52 | 35.92 | 234 | 4,099.68 | 8,405.28 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 芯生命 | 年1月28日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 688781 | 视涯科技 | 2026年3月18日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.68 | 47.61 | 215 | 4,876.20 | 10,236.15 | - |
| 688785 | 恒运昌 | 2026年1月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 92.18 | 463.15 | 116 | 10,692.88 | 53,725.40 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026年6月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.56 | 468.67 | 196 | 8,733.76 | 91,859.32 | - |
| 688811 | 有研复材 | 2026年4月1日 | 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年3月24日 | 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年2月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.95 | 57.10 | 177 | 9,903.15 | 10,106.70 | - |
| 688818 | 电科蓝天 | 2026年2月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.47 | 70.14 | 1,717 | 16,259.99 | 120,430.38 | - |
| 688820 | 盛合晶微 | 2026年4月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.68 | 141.49 | 929 | 18,282.72 | 131,444.21 | - |

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板、创业板股份，在受让后6个月内不得转让。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688072 | 拓荆科技 | 2026年6月29日 | 重大事项停牌 | 879.53 | 2026年7月13日 | 890.99 | 134 | 67,429.16 | 117,857.02 | - |

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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<br>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 | 35,036,733.16 | - | - | - | 35,036,733.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 443,500,176.38 | 443,500,176.38 |
| 应收申购款 | - | - | - | 332,865.69 | 332,865.69 |
| 资产总计 | 35,036,733.16 | - | - | 443,833,042.07 | 478,869,775.23 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,943,972.84 | 1,943,972.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 319,101.52 | 319,101.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | 59,831.52 | 59,831.52 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 90,555.26 | 90,555.26 |
| 其他负债 | - | - | - | 112,054.60 | 112,054.60 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,525,515.74 | 2,525,515.74 |
| 利率敏感度缺口 | 35,036,733.16 | - | - | 441,307,526.33 | 476,344,259.49 |
| 上年度末<br>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 | 81,390,337.23 | - | - | - | 81,390,337.23 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 848,678,884.63 | 848,678,884.63 |
| 应收申购款 | - | - | - | 586,009.95 | 586,009.95 |
| 资产总计 | 81,390,337.23 | - | - | 849,264,894.58 | 930,655,231.81 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 24,149,037.48 | 24,149,037.48 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 648,530.90 | 648,530.90 |
| 应付托管费 | - | - | - | 121,599.55 | 121,599.55 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 189,550.55 | 189,550.55 |
| 其他负债 | - | - | - | 43,096.37 | 43,096.37 |
| 负债总计 | - | - | - | 25,151,814.85 | 25,151,814.85 |
| 利率敏感度缺口 | 81,390,337.23 | - | - | 824,113,079.73 | 905,503,416.96 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的利率敏感性资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金

净资产无重大影响。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>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 | 443,500,176.38 | 93.10 | 848,678,884.63 | 93.72 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 443,500,176.38 | 93.10 | 848,678,884.63 | 93.72 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|---|---|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； |
| | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险； |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | Beta系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 | | |
| 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） |
| | 业绩比较基准上升5% | 21,032,815.27 | 30,240,829.34 |
| | 业绩比较基准下降5% | -21,032,815.27 | -30,240,829.34 |

## 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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 441,777,522.52 | 845,010,366.01 |
| 第二层次 | 331,562.20 | 3,396,313.64 |
| 第三层次 | 1,391,091.66 | 272,204.98 |
| 合计 | 443,500,176.38 | 848,678,884.63 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第

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

本基金本报告期末及上年度末均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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

# §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 | 443,500,176.38 | 92.61 |
| | 其中：股票 | 443,500,176.38 | 92.61 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 35,036,733.16 | 7.32 |
| 8 | 其他各项资产 | 332,865.69 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 478,869,775.23 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资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 | 335,751.00 | 0.07 |
| B | 采矿业 | 12,868,812.08 | 2.70 |
| C | 制造业 | 278,864,204.17 | 58.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,529,587.00 | 2.21 |
| E | 建筑业 | 5,460,616.00 | 1.15 |
| F | 批发和零售业 | 3,092,474.00 | 0.65 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,871,345.00 | 2.28 |
| H | 住宿和餐饮业 | 355,992.00 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 20,194,433.14 | 4.24 |
| J | 金融业 | 37,363,100.60 | 7.84 |
| K | 房地产业 | 2,277,260.32 | 0.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,273,056.00 | 0.69 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,104,335.00 | 0.86 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 821,093.20 | 0.17 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 56,700.00 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 937,472.00 | 0.20 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 50,753.00 | 0.01 |
| S | 综合 | 156,948.00 | 0.03 |
| | 合计 | 391,613,932.51 | 82.21 |

### 7.2.2 报告期末积极投资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 | 75,486.00 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 3,068,519.82 | 0.64 |
| C | 制造业 | 37,111,976.78 | 7.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 460,113.18 | 0.10 |
| E | 建筑业 | 280,980.00 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 422,164.00 | 0.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,583.46 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,314,217.85 | 0.49 |
| J | 金融业 | 7,145,494.80 | 1.50 |
| K | 房地产业 | 211,976.00 | 0.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 293,877.98 | 0.06 |
| N | 水利、环境和公共 | 99,876.00 | 0.02 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 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 | 399,978.00 | 0.08 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 51,886,243.87 | 10.89 |

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300308 | 中际旭创 | 14,800 | 18,796,000.00 | 3.95 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 33,800 | 13,283,738.00 | 2.79 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 18,580 | 11,278,060.00 | 2.37 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 6,150 | 7,290,763.50 | 1.53 |
| 5 | 688981 | 中芯国际 | 41,188 | 6,541,478.16 | 1.37 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 90,100 | 6,343,040.00 | 1.33 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 846,400 | 5,984,048.00 | 1.26 |
| 8 | 000725 | 京东方A | 686,500 | 5,958,820.00 | 1.25 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 321,900 | 5,330,664.00 | 1.12 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 6,000 | 5,307,360.00 | 1.11 |
| 11 | 002916 | 深南电路 | 11,312 | 5,179,764.80 | 1.09 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 107,800 | 5,146,372.00 | 1.08 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业 | 197,422 | 4,963,189.08 | 1.04 |
| 14 | 688256 | 寒武纪 | 2,890 | 4,611,139.50 | 0.97 |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 167,800 | 4,441,666.00 | 0.93 |
| 16 | 688041 | 海光信息 | 11,980 | 4,436,194.00 | 0.93 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 153,400 | 4,407,182.00 | 0.93 |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 57,700 | 4,358,081.00 | 0.91 |
| 19 | 002384 | 东山精密 | 15,500 | 4,066,425.00 | 0.85 |
| 20 | 002938 | 鹏鼎控股 | 35,000 | 3,688,300.00 | 0.77 |
| 21 | 603986 | 兆易创新 | 4,400 | 3,586,000.00 | 0.75 |
| 22 | 300274 | 阳光电源 | 22,300 | 3,546,146.00 | 0.74 |
| 23 | 688347 | 华虹宏力 | 10,093 | 3,394,275.90 | 0.71 |
| 24 | 000338 | 潍柴动力 | 116,900 | 3,185,525.00 | 0.67 |
| 25 | 603259 | 药明康德 | 24,900 | 3,100,299.00 | 0.65 |
| 26 | 688008 | 澜起科技 | 8,971 | 2,780,112.90 | 0.58 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 27 | 603019 | 中科曙光 | 24,700 | 2,648,581.00 | 0.56 |
| 28 | 688012 | 中微公司 | 5,552 | 2,601,112.00 | 0.55 |
| 29 | 601288 | 农业银行 | 405,000 | 2,458,350.00 | 0.52 |
| 30 | 000792 | 盐湖股份 | 79,400 | 2,397,086.00 | 0.50 |
| 31 | 300408 | 三环集团 | 14,300 | 2,386,670.00 | 0.50 |
| 32 | 300394 | 天孚通信 | 7,840 | 2,373,011.20 | 0.50 |
| 33 | 600309 | 万华化学 | 34,400 | 2,353,304.00 | 0.49 |
| 34 | 601872 | 招商轮船 | 133,900 | 2,352,623.00 | 0.49 |
| 35 | 300857 | 协创数据 | 6,900 | 2,345,310.00 | 0.49 |
| 36 | 300124 | 汇川技术 | 35,000 | 2,321,550.00 | 0.49 |
| 37 | 600150 | 中国船舶 | 64,800 | 2,189,592.00 | 0.46 |
| 38 | 002594 | 比亚迪 | 27,300 | 2,175,810.00 | 0.46 |
| 39 | 300059 | 东方财富 | 105,400 | 2,148,052.00 | 0.45 |
| 40 | 000651 | 格力电器 | 55,200 | 2,070,000.00 | 0.43 |
| 41 | 002532 | 天山铝业 | 192,900 | 2,069,817.00 | 0.43 |
| 42 | 000001 | 平安银行 | 201,800 | 2,028,090.00 | 0.43 |
| 43 | 600487 | 亨通光电 | 18,300 | 2,000,922.00 | 0.42 |
| 44 | 000063 | 中兴通讯 | 53,200 | 1,925,308.00 | 0.40 |
| 45 | 000630 | 铜陵有色 | 293,700 | 1,867,932.00 | 0.39 |
| 46 | 002050 | 三花智控 | 42,600 | 1,867,158.00 | 0.39 |
| 47 | 000807 | 云铝股份 | 83,900 | 1,857,546.00 | 0.39 |
| 48 | 300450 | 先导智能 | 45,500 | 1,852,760.00 | 0.39 |
| 49 | 601988 | 中国银行 | 311,900 | 1,784,068.00 | 0.37 |
| 50 | 600392 | 盛和资源 | 59,300 | 1,765,361.00 | 0.37 |
| 51 | 600346 | 恒力石化 | 98,600 | 1,746,206.00 | 0.37 |
| 52 | 600893 | 航发动力 | 44,400 | 1,702,296.00 | 0.36 |
| 53 | 000988 | 华工科技 | 9,218 | 1,701,734.98 | 0.36 |
| 54 | 002415 | 海康威视 | 48,900 | 1,672,380.00 | 0.35 |
| 55 | 601211 | 国泰海通 | 91,868 | 1,671,997.60 | 0.35 |
| 56 | 601100 | 恒立液压 | 15,500 | 1,667,180.00 | 0.35 |
| 57 | 300136 | 信维通信 | 13,600 | 1,621,800.00 | 0.34 |
| 58 | 600011 | 华能国际 | 207,500 | 1,574,925.00 | 0.33 |
| 59 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,300 | 1,570,750.00 | 0.33 |
| 60 | 300001 | 特锐德 | 40,700 | 1,539,681.00 | 0.32 |
| 61 | 300454 | 深信服 | 15,700 | 1,510,340.00 | 0.32 |
| 62 | 300418 | 昆仑万维 | 37,400 | 1,509,464.00 | 0.32 |
| 63 | 002281 | 光迅科技 | 5,800 | 1,490,252.00 | 0.31 |
| 64 | 002493 | 荣盛石化 | 134,900 | 1,450,175.00 | 0.30 |
| 65 | 600176 | 中国巨石 | 19,700 | 1,435,736.00 | 0.30 |
| 66 | 300972 | 万辰集团 | 8,200 | 1,421,962.00 | 0.30 |
| 67 | 300476 | 胜宏科技 | 4,100 | 1,420,363.00 | 0.30 |
| 68 | 601728 | 中国电信 | 269,500 | 1,398,705.00 | 0.29 |
| 69 | 600026 | 中远海能 | 77,500 | 1,390,350.00 | 0.29 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 70 | 601985 | 中国核电 | 143,900 | 1,299,417.00 | 0.27 |
| 71 | 002195 | 岩山科技 | 195,173 | 1,276,431.42 | 0.27 |
| 72 | 600875 | 东方电气 | 44,300 | 1,274,511.00 | 0.27 |
| 73 | 601328 | 交通银行 | 196,800 | 1,265,424.00 | 0.27 |
| 74 | 600522 | 中天科技 | 20,800 | 1,262,144.00 | 0.26 |
| 75 | 600887 | 伊利股份 | 51,800 | 1,241,128.00 | 0.26 |
| 76 | 600941 | 中国移动 | 14,400 | 1,240,272.00 | 0.26 |
| 77 | 300014 | 亿纬锂能 | 18,900 | 1,229,067.00 | 0.26 |
| 78 | 600000 | 浦发银行 | 142,400 | 1,226,064.00 | 0.26 |
| 79 | 601816 | 京沪高铁 | 270,200 | 1,224,006.00 | 0.26 |
| 80 | 601668 | 中国建筑 | 279,900 | 1,214,766.00 | 0.26 |
| 81 | 600031 | 三一重工 | 70,100 | 1,211,328.00 | 0.25 |
| 82 | 600362 | 江西铜业 | 27,600 | 1,195,080.00 | 0.25 |
| 83 | 300661 | 圣邦股份 | 8,300 | 1,190,884.00 | 0.25 |
| 84 | 601689 | 拓普集团 | 20,300 | 1,145,326.00 | 0.24 |
| 85 | 000408 | 藏格矿业 | 16,500 | 1,143,780.00 | 0.24 |
| 86 | 302132 | 中航成飞 | 19,500 | 1,137,240.00 | 0.24 |
| 87 | 600089 | 特变电工 | 50,400 | 1,134,000.00 | 0.24 |
| 88 | 002602 | 世纪华通 | 79,700 | 1,123,770.00 | 0.24 |
| 89 | 000967 | 盈峰环境 | 105,600 | 1,111,968.00 | 0.23 |
| 90 | 600183 | 生益科技 | 6,200 | 1,075,080.00 | 0.23 |
| 91 | 600938 | 中国海油 | 38,000 | 1,031,700.00 | 0.22 |
| 92 | 600276 | 恒瑞医药 | 19,742 | 1,027,373.68 | 0.22 |
| 93 | 600690 | 海尔智家 | 48,600 | 991,926.00 | 0.21 |
| 94 | 688266 | 泽璟制药 | 8,463 | 987,293.58 | 0.21 |
| 95 | 601233 | 桐昆股份 | 45,400 | 982,910.00 | 0.21 |
| 96 | 000100 | TCL科技 | 168,700 | 981,834.00 | 0.21 |
| 97 | 002008 | 大族激光 | 6,500 | 975,715.00 | 0.20 |
| 98 | 688002 | 睿创微纳 | 6,295 | 973,773.55 | 0.20 |
| 99 | 300390 | 天华新能 | 10,300 | 963,153.00 | 0.20 |
| 100 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,700 | 961,380.00 | 0.20 |
| 101 | 688120 | 华海清科 | 2,982 | 960,740.76 | 0.20 |
| 102 | 000415 | 渤海租赁 | 234,300 | 953,601.00 | 0.20 |
| 103 | 002851 | 麦格米特 | 5,700 | 952,926.00 | 0.20 |
| 104 | 600160 | 巨化股份 | 17,900 | 948,879.00 | 0.20 |
| 105 | 600988 | 赤峰黄金 | 36,000 | 947,520.00 | 0.20 |
| 106 | 002463 | 沪电股份 | 6,200 | 947,360.00 | 0.20 |
| 107 | 002600 | 领益智造 | 54,000 | 936,360.00 | 0.20 |
| 108 | 600460 | 士兰微 | 17,100 | 934,686.00 | 0.20 |
| 109 | 688525 | 佰维存储 | 1,865 | 922,671.45 | 0.19 |
| 110 | 002131 | 利欧股份 | 193,500 | 919,125.00 | 0.19 |
| 111 | 601088 | 中国神华 | 23,500 | 917,440.00 | 0.19 |
| 112 | 002466 | 天齐锂业 | 14,900 | 913,668.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 113 | 300054 | 鼎龙股份 | 8,600 | 911,342.00 | 0.19 |
| 114 | 600989 | 宝丰能源 | 42,600 | 866,058.00 | 0.18 |
| 115 | 688396 | 华润微 | 8,821 | 860,488.55 | 0.18 |
| 116 | 603799 | 华友钴业 | 17,800 | 859,028.00 | 0.18 |
| 117 | 301308 | 江波龙 | 1,200 | 844,560.00 | 0.18 |
| 118 | 300866 | 安克创新 | 8,000 | 836,000.00 | 0.18 |
| 119 | 300677 | 英科医疗 | 21,319 | 835,065.23 | 0.18 |
| 120 | 002028 | 思源电气 | 4,800 | 830,400.00 | 0.17 |
| 121 | 002812 | 恩捷股份 | 12,400 | 829,684.00 | 0.17 |
| 122 | 002202 | 金风科技 | 34,600 | 826,940.00 | 0.17 |
| 123 | 300223 | 君正股份 | 3,300 | 821,370.00 | 0.17 |
| 124 | 600699 | 均胜电子 | 36,934 | 798,143.74 | 0.17 |
| 125 | 601857 | 中国石油 | 90,700 | 787,276.00 | 0.17 |
| 126 | 601601 | 中国太保 | 27,200 | 775,744.00 | 0.16 |
| 127 | 000858 | 五 粮 液 | 10,400 | 769,600.00 | 0.16 |
| 128 | 688498 | 源杰科技 | 400 | 754,400.00 | 0.16 |
| 129 | 600795 | 国电电力 | 156,700 | 731,789.00 | 0.15 |
| 130 | 000032 | 深桑达A | 29,000 | 723,550.00 | 0.15 |
| 131 | 601628 | 中国人寿 | 20,400 | 721,140.00 | 0.15 |
| 132 | 688390 | 固德威 | 6,633 | 719,746.83 | 0.15 |
| 133 | 002352 | 顺丰控股 | 22,800 | 712,728.00 | 0.15 |
| 134 | 601006 | 大秦铁路 | 154,000 | 709,940.00 | 0.15 |
| 135 | 600115 | 中国东航 | 185,200 | 705,612.00 | 0.15 |
| 136 | 002405 | 四维图新 | 108,900 | 704,583.00 | 0.15 |
| 137 | 300207 | 欣旺达 | 37,000 | 702,630.00 | 0.15 |
| 138 | 601127 | 赛力斯 | 11,400 | 698,250.00 | 0.15 |
| 139 | 002126 | 银轮股份 | 14,000 | 697,200.00 | 0.15 |
| 140 | 300757 | 罗博特科 | 1,100 | 680,900.00 | 0.14 |
| 141 | 000039 | 中集集团 | 82,800 | 671,508.00 | 0.14 |
| 142 | 300037 | 新宙邦 | 7,200 | 668,520.00 | 0.14 |
| 143 | 002049 | 紫光国微 | 7,500 | 665,625.00 | 0.14 |
| 144 | 000977 | 浪潮信息 | 9,500 | 665,000.00 | 0.14 |
| 145 | 002044 | 美年健康 | 131,200 | 659,936.00 | 0.14 |
| 146 | 601615 | 明阳智能 | 57,000 | 659,490.00 | 0.14 |
| 147 | 601727 | 上海电气 | 93,000 | 651,000.00 | 0.14 |
| 148 | 000938 | 紫光股份 | 22,500 | 649,350.00 | 0.14 |
| 149 | 300604 | 长川科技 | 1,900 | 648,698.00 | 0.14 |
| 150 | 688777 | 中控技术 | 5,485 | 644,487.50 | 0.14 |
| 151 | 601658 | 邮储银行 | 130,000 | 640,900.00 | 0.13 |
| 152 | 002179 | 中航光电 | 13,800 | 637,560.00 | 0.13 |
| 153 | 300567 | 精测电子 | 2,000 | 635,200.00 | 0.13 |
| 154 | 600010 | 包钢股份 | 282,000 | 628,860.00 | 0.13 |
| 155 | 600418 | 江淮汽车 | 24,300 | 627,669.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 156 | 002603 | 以岭药业 | 41,000 | 615,000.00 | 0.13 |
| 157 | 002080 | 中材科技 | 6,800 | 612,000.00 | 0.13 |
| 158 | 601600 | 中国铝业 | 74,100 | 609,102.00 | 0.13 |
| 159 | 601225 | 陕西煤业 | 29,900 | 608,465.00 | 0.13 |
| 160 | 601186 | 中国铁建 | 102,200 | 608,090.00 | 0.13 |
| 161 | 000425 | 徐工机械 | 74,900 | 605,941.00 | 0.13 |
| 162 | 600547 | 山东黄金 | 26,200 | 604,958.00 | 0.13 |
| 163 | 601919 | 中远海控 | 45,500 | 603,330.00 | 0.13 |
| 164 | 002185 | 华天科技 | 26,900 | 600,139.00 | 0.13 |
| 165 | 603993 | 洛阳钼业 | 33,600 | 589,680.00 | 0.12 |
| 166 | 601360 | 三六零 | 67,500 | 586,575.00 | 0.12 |
| 167 | 600141 | 兴发集团 | 12,400 | 582,428.00 | 0.12 |
| 168 | 002709 | 天赐材料 | 11,300 | 581,159.00 | 0.12 |
| 169 | 002138 | 顺络电子 | 7,900 | 577,490.00 | 0.12 |
| 170 | 002273 | 水晶光电 | 16,100 | 571,228.00 | 0.12 |
| 171 | 601868 | 中国能建 | 213,300 | 569,511.00 | 0.12 |
| 172 | 688617 | 惠泰医疗 | 3,089 | 560,838.84 | 0.12 |
| 173 | 688599 | 天合光能 | 39,508 | 557,852.96 | 0.12 |
| 174 | 003816 | 中国广核 | 141,200 | 552,092.00 | 0.12 |
| 175 | 600489 | 中金黄金 | 30,500 | 550,525.00 | 0.12 |
| 176 | 600816 | 建元信托 | 225,600 | 550,464.00 | 0.12 |
| 177 | 300803 | 指南针 | 6,000 | 550,020.00 | 0.12 |
| 178 | 002738 | 中矿资源 | 9,200 | 542,708.00 | 0.11 |
| 179 | 002414 | 高德红外 | 40,900 | 542,334.00 | 0.11 |
| 180 | 688235 | 百济神州 | 2,106 | 536,208.66 | 0.11 |
| 181 | 000568 | 泸州老窖 | 6,900 | 534,888.00 | 0.11 |
| 182 | 600406 | 国电南瑞 | 23,300 | 532,405.00 | 0.11 |
| 183 | 002340 | 格林美 | 80,400 | 531,444.00 | 0.11 |
| 184 | 688521 | 芯原股份 | 1,416 | 525,534.24 | 0.11 |
| 185 | 300083 | 创世纪 | 38,500 | 524,370.00 | 0.11 |
| 186 | 605589 | 圣泉集团 | 8,200 | 521,274.00 | 0.11 |
| 187 | 002432 | 九安医疗 | 7,300 | 515,964.00 | 0.11 |
| 188 | 601012 | 隆基绿能 | 39,300 | 515,616.00 | 0.11 |
| 189 | 002436 | 兴森科技 | 10,000 | 509,500.00 | 0.11 |
| 190 | 002558 | 巨人网络 | 18,300 | 504,348.00 | 0.11 |
| 191 | 600316 | 洪都航空 | 18,000 | 502,920.00 | 0.11 |
| 192 | 600482 | 中国动力 | 15,100 | 495,280.00 | 0.10 |
| 193 | 688180 | 君实生物 | 14,624 | 494,583.68 | 0.10 |
| 194 | 601766 | 中国中车 | 94,700 | 492,440.00 | 0.10 |
| 195 | 601111 | 中国国航 | 81,100 | 490,655.00 | 0.10 |
| 196 | 601669 | 中国电建 | 103,500 | 486,450.00 | 0.10 |
| 197 | 600177 | 雅戈尔 | 64,400 | 484,932.00 | 0.10 |
| 198 | 688469 | 芯联集成 | 45,659 | 484,441.99 | 0.10 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 199 | 002241 | 歌尔股份 | 21,500 | 484,395.00 | 0.10 |
| 200 | 300432 | 富临精工 | 24,100 | 484,169.00 | 0.10 |
| 201 | 300751 | 迈为股份 | 1,700 | 480,182.00 | 0.10 |
| 202 | 688126 | 沪硅产业 | 11,858 | 473,015.62 | 0.10 |
| 203 | 300759 | 康龙化成 | 16,200 | 468,666.00 | 0.10 |
| 204 | 600886 | 国投电力 | 35,100 | 467,181.00 | 0.10 |
| 205 | 600143 | 金发科技 | 30,100 | 465,045.00 | 0.10 |
| 206 | 000301 | 东方盛虹 | 40,400 | 462,580.00 | 0.10 |
| 207 | 002027 | 分众传媒 | 95,000 | 459,800.00 | 0.10 |
| 208 | 600660 | 福耀玻璃 | 9,000 | 453,960.00 | 0.10 |
| 209 | 688213 | 思特威 | 4,234 | 453,334.38 | 0.10 |
| 210 | 300316 | 晶盛机电 | 7,500 | 453,000.00 | 0.10 |
| 211 | 300058 | 蓝色光标 | 32,800 | 451,328.00 | 0.09 |
| 212 | 600667 | 太极实业 | 15,400 | 449,372.00 | 0.09 |
| 213 | 600584 | 长电科技 | 4,300 | 445,265.00 | 0.09 |
| 214 | 601390 | 中国中铁 | 106,600 | 444,522.00 | 0.09 |
| 215 | 002025 | 航天电器 | 5,800 | 442,076.00 | 0.09 |
| 216 | 002236 | 大华股份 | 26,800 | 441,932.00 | 0.09 |
| 217 | 300474 | 景嘉微 | 7,300 | 441,504.00 | 0.09 |
| 218 | 000035 | 中国天楹 | 91,200 | 440,496.00 | 0.09 |
| 219 | 300017 | 网宿科技 | 33,500 | 435,835.00 | 0.09 |
| 220 | 002648 | 卫星化学 | 18,500 | 434,565.00 | 0.09 |
| 221 | 688122 | 西部超导 | 6,909 | 433,954.29 | 0.09 |
| 222 | 688303 | 大全能源 | 24,842 | 432,996.06 | 0.09 |
| 223 | 600711 | 盛屯矿业 | 39,400 | 432,218.00 | 0.09 |
| 224 | 601117 | 中国化学 | 58,800 | 432,180.00 | 0.09 |
| 225 | 002472 | 双环传动 | 10,400 | 431,704.00 | 0.09 |
| 226 | 002465 | 海格通信 | 33,600 | 429,072.00 | 0.09 |
| 227 | 300496 | 中科创达 | 6,900 | 426,351.00 | 0.09 |
| 228 | 600166 | 福田汽车 | 146,200 | 425,442.00 | 0.09 |
| 229 | 300115 | 长盈精密 | 15,200 | 424,688.00 | 0.09 |
| 230 | 300049 | 福瑞医科 | 10,900 | 423,792.00 | 0.09 |
| 231 | 600741 | 华域汽车 | 27,300 | 423,696.00 | 0.09 |
| 232 | 601058 | 赛轮轮胎 | 36,500 | 420,845.00 | 0.09 |
| 233 | 601168 | 西部矿业 | 15,500 | 420,670.00 | 0.09 |
| 234 | 688676 | 金盘科技 | 4,943 | 418,375.52 | 0.09 |
| 235 | 300724 | 捷佳伟创 | 5,900 | 416,540.00 | 0.09 |
| 236 | 000733 | 振华科技 | 7,200 | 407,808.00 | 0.09 |
| 237 | 300012 | 华测检测 | 29,400 | 407,484.00 | 0.09 |
| 238 | 000034 | 神州数码 | 14,680 | 407,370.00 | 0.09 |
| 239 | 001979 | 招商蛇口 | 63,300 | 407,019.00 | 0.09 |
| 240 | 300073 | 当升科技 | 8,300 | 398,732.00 | 0.08 |
| 241 | 688099 | 晶晨股份 | 3,800 | 391,020.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 242 | 300442 | 润泽科技 | 4,700 | 390,429.00 | 0.08 |
| 243 | 605117 | 德业股份 | 3,640 | 386,495.20 | 0.08 |
| 244 | 600436 | 片仔癀 | 3,500 | 382,480.00 | 0.08 |
| 245 | 601567 | 三星电气 | 25,300 | 377,982.00 | 0.08 |
| 246 | 000887 | 中鼎股份 | 21,100 | 377,479.00 | 0.08 |
| 247 | 000830 | 鲁西化工 | 31,300 | 375,600.00 | 0.08 |
| 248 | 600050 | 中国联通 | 93,800 | 375,200.00 | 0.08 |
| 249 | 600879 | 航天电子 | 17,600 | 374,704.00 | 0.08 |
| 250 | 688166 | 博瑞医药 | 10,612 | 371,526.12 | 0.08 |
| 251 | 601000 | 唐山港 | 88,800 | 368,520.00 | 0.08 |
| 252 | 603596 | 伯特利 | 14,832 | 368,426.88 | 0.08 |
| 253 | 002130 | 沃尔核材 | 19,100 | 362,136.00 | 0.08 |
| 254 | 688608 | 恒玄科技 | 2,157 | 360,628.83 | 0.08 |
| 255 | 600905 | 三峡能源 | 95,600 | 354,676.00 | 0.07 |
| 256 | 600839 | 四川长虹 | 50,700 | 353,886.00 | 0.07 |
| 257 | 600111 | 北方稀土 | 7,200 | 345,960.00 | 0.07 |
| 258 | 002244 | 滨江集团 | 45,200 | 343,520.00 | 0.07 |
| 259 | 002120 | 韵达股份 | 53,600 | 340,896.00 | 0.07 |
| 260 | 002001 | 新 和 成 | 11,900 | 338,198.00 | 0.07 |
| 261 | 300433 | 蓝思科技 | 6,300 | 338,058.00 | 0.07 |
| 262 | 002837 | 英维克 | 4,240 | 337,334.40 | 0.07 |
| 263 | 002074 | 国轩高科 | 12,000 | 330,120.00 | 0.07 |
| 264 | 600803 | 新奥股份 | 20,800 | 328,640.00 | 0.07 |
| 265 | 600674 | 川投能源 | 23,000 | 325,910.00 | 0.07 |
| 266 | 000932 | 华菱钢铁 | 93,400 | 324,098.00 | 0.07 |
| 267 | 601216 | 君正集团 | 72,600 | 323,796.00 | 0.07 |
| 268 | 000625 | 长安汽车 | 44,800 | 321,216.00 | 0.07 |
| 269 | 601319 | 中国人保 | 47,400 | 320,424.00 | 0.07 |
| 270 | 000683 | 博源化工 | 55,300 | 318,528.00 | 0.07 |
| 271 | 002714 | 牧原股份 | 9,100 | 318,409.00 | 0.07 |
| 272 | 002266 | 浙富控股 | 62,700 | 317,262.00 | 0.07 |
| 273 | 688472 | 阿特斯 | 29,149 | 315,392.18 | 0.07 |
| 274 | 601866 | 中远海发 | 141,200 | 312,052.00 | 0.07 |
| 275 | 600499 | 科达制造 | 22,600 | 311,880.00 | 0.07 |
| 276 | 688223 | 晶科能源 | 65,553 | 311,376.75 | 0.07 |
| 277 | 000975 | 山金国际 | 18,300 | 311,100.00 | 0.07 |
| 278 | 600998 | 九州通 | 65,900 | 309,071.00 | 0.06 |
| 279 | 600325 | 华发股份 | 133,500 | 308,385.00 | 0.06 |
| 280 | 688009 | 中国通号 | 64,275 | 305,949.00 | 0.06 |
| 281 | 002756 | 永兴材料 | 5,400 | 305,856.00 | 0.06 |
| 282 | 002271 | 东方雨虹 | 25,700 | 305,059.00 | 0.06 |
| 283 | 600208 | 衢州发展 | 106,900 | 302,527.00 | 0.06 |
| 284 | 002155 | 湖南黄金 | 12,600 | 300,762.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 285 | 600008 | 首创环保 | 107,600 | 292,672.00 | 0.06 |
| 286 | 688116 | 天奈科技 | 7,659 | 292,573.80 | 0.06 |
| 287 | 600066 | 宇通客车 | 10,900 | 292,229.00 | 0.06 |
| 288 | 001965 | 招商公路 | 31,900 | 292,204.00 | 0.06 |
| 289 | 600426 | 华鲁恒升 | 12,100 | 289,432.00 | 0.06 |
| 290 | 601888 | 中国中免 | 5,300 | 284,663.00 | 0.06 |
| 291 | 600754 | 锦江酒店 | 15,600 | 280,644.00 | 0.06 |
| 292 | 002517 | 恺英网络 | 16,900 | 274,625.00 | 0.06 |
| 293 | 300475 | 香农芯创 | 900 | 270,000.00 | 0.06 |
| 294 | 600352 | 浙江龙盛 | 22,100 | 267,631.00 | 0.06 |
| 295 | 300142 | 沃森生物 | 20,500 | 266,295.00 | 0.06 |
| 296 | 600048 | 保利发展 | 56,920 | 263,539.60 | 0.06 |
| 297 | 600233 | 圆通速递 | 16,600 | 261,450.00 | 0.05 |
| 298 | 600885 | 宏发股份 | 7,500 | 258,675.00 | 0.05 |
| 299 | 601179 | 中国西电 | 17,000 | 253,640.00 | 0.05 |
| 300 | 002422 | 科伦药业 | 6,500 | 250,380.00 | 0.05 |
| 301 | 600895 | 张江高科 | 6,700 | 249,575.00 | 0.05 |
| 302 | 000423 | 东阿阿胶 | 5,500 | 249,480.00 | 0.05 |
| 303 | 600019 | 宝钢股份 | 45,900 | 249,237.00 | 0.05 |
| 304 | 300763 | 锦浪科技 | 2,700 | 243,945.00 | 0.05 |
| 305 | 000738 | 航发控制 | 13,300 | 243,257.00 | 0.05 |
| 306 | 000538 | 云南白药 | 5,000 | 236,850.00 | 0.05 |
| 307 | 002318 | 久立特材 | 9,800 | 234,220.00 | 0.05 |
| 308 | 300033 | 同花顺 | 960 | 231,360.00 | 0.05 |
| 309 | 600219 | 南山铝业 | 56,700 | 226,233.00 | 0.05 |
| 310 | 600580 | 卧龙电驱 | 6,800 | 225,080.00 | 0.05 |
| 311 | 688506 | 百利天恒 | 761 | 223,756.83 | 0.05 |
| 312 | 603885 | 吉祥航空 | 21,300 | 219,177.00 | 0.05 |
| 313 | 002595 | 豪迈科技 | 4,700 | 219,020.00 | 0.05 |
| 314 | 002078 | 太阳纸业 | 17,500 | 218,575.00 | 0.05 |
| 315 | 603501 | 豪威集团 | 2,300 | 218,155.00 | 0.05 |
| 316 | 600760 | 中航沈飞 | 5,300 | 217,830.00 | 0.05 |
| 317 | 600398 | 海澜之家 | 40,800 | 213,384.00 | 0.04 |
| 318 | 600039 | 四川路桥 | 27,200 | 212,704.00 | 0.04 |
| 319 | 600029 | 南方航空 | 40,500 | 209,790.00 | 0.04 |
| 320 | 601238 | 广汽集团 | 40,300 | 204,724.00 | 0.04 |
| 321 | 002230 | 科大讯飞 | 5,000 | 204,200.00 | 0.04 |
| 322 | 603288 | 海天味业 | 6,100 | 202,276.00 | 0.04 |
| 323 | 600763 | 通策医疗 | 5,900 | 199,892.00 | 0.04 |
| 324 | 603659 | 璞泰来 | 6,900 | 199,617.00 | 0.04 |
| 325 | 600765 | 中航重机 | 15,000 | 193,800.00 | 0.04 |
| 326 | 688047 | 龙芯中科 | 1,252 | 193,646.84 | 0.04 |
| 327 | 000157 | 中联重科 | 27,600 | 192,372.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 328 | 002601 | 龙佰集团 | 11,500 | 189,520.00 | 0.04 |
| 329 | 600018 | 上港集团 | 40,100 | 189,272.00 | 0.04 |
| 330 | 600549 | 厦门钨业 | 2,200 | 187,440.00 | 0.04 |
| 331 | 002410 | 广联达 | 22,700 | 185,232.00 | 0.04 |
| 332 | 600570 | 恒生电子 | 8,600 | 182,234.00 | 0.04 |
| 333 | 002156 | 通富微电 | 2,400 | 182,088.00 | 0.04 |
| 334 | 000657 | 中钨高新 | 1,900 | 181,868.00 | 0.04 |
| 335 | 600704 | 物产中大 | 38,000 | 179,360.00 | 0.04 |
| 336 | 600415 | 小商品城 | 17,400 | 176,784.00 | 0.04 |
| 337 | 600170 | 上海建工 | 78,500 | 174,270.00 | 0.04 |
| 338 | 600862 | 中航高科 | 9,500 | 171,285.00 | 0.04 |
| 339 | 601018 | 宁波港 | 53,900 | 169,785.00 | 0.04 |
| 340 | 300832 | 新产业 | 4,000 | 168,000.00 | 0.04 |
| 341 | 600588 | 用友网络 | 18,100 | 166,158.00 | 0.03 |
| 342 | 000400 | 许继电气 | 7,600 | 164,920.00 | 0.03 |
| 343 | 002920 | 德赛西威 | 2,000 | 163,000.00 | 0.03 |
| 344 | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,200 | 162,996.00 | 0.03 |
| 345 | 601607 | 上海医药 | 10,500 | 161,700.00 | 0.03 |
| 346 | 600511 | 国药股份 | 6,200 | 161,448.00 | 0.03 |
| 347 | 000999 | 华润三九 | 7,100 | 159,679.00 | 0.03 |
| 348 | 000786 | 北新建材 | 8,800 | 159,192.00 | 0.03 |
| 349 | 603806 | 福斯特 | 9,400 | 157,826.00 | 0.03 |
| 350 | 600486 | 扬农化工 | 3,100 | 157,170.00 | 0.03 |
| 351 | 002064 | 华峰化学 | 16,500 | 156,585.00 | 0.03 |
| 352 | 002625 | 光启技术 | 5,100 | 154,632.00 | 0.03 |
| 353 | 600332 | 白云山 | 7,700 | 154,308.00 | 0.03 |
| 354 | 600372 | 中航机载 | 14,200 | 154,070.00 | 0.03 |
| 355 | 300748 | 金力永磁 | 4,900 | 151,165.00 | 0.03 |
| 356 | 600085 | 同仁堂 | 6,100 | 140,971.00 | 0.03 |
| 357 | 688111 | 金山办公 | 660 | 140,613.00 | 0.03 |
| 358 | 000519 | 中兵红箭 | 6,600 | 139,062.00 | 0.03 |
| 359 | 002065 | 东华软件 | 19,400 | 138,516.00 | 0.03 |
| 360 | 601877 | 正泰电器 | 5,400 | 135,378.00 | 0.03 |
| 361 | 002007 | 华兰生物 | 11,000 | 134,090.00 | 0.03 |
| 362 | 300395 | 菲利华 | 1,000 | 133,730.00 | 0.03 |
| 363 | 002223 | 鱼跃医疗 | 5,200 | 133,432.00 | 0.03 |
| 364 | 600028 | 中国石化 | 29,500 | 131,570.00 | 0.03 |
| 365 | 300003 | 乐普医疗 | 10,900 | 129,165.00 | 0.03 |
| 366 | 600312 | 平高电气 | 7,300 | 128,918.00 | 0.03 |
| 367 | 603129 | 春风动力 | 500 | 127,900.00 | 0.03 |
| 368 | 600515 | 海南机场 | 46,600 | 127,684.00 | 0.03 |
| 369 | 600585 | 海螺水泥 | 7,500 | 127,125.00 | 0.03 |
| 370 | 600064 | 南京高科 | 17,700 | 126,201.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 371 | 601677 | 明泰铝业 | 7,600 | 126,160.00 | 0.03 |
| 372 | 600535 | 天士力 | 9,500 | 125,685.00 | 0.03 |
| 373 | 600529 | 山东药玻 | 6,800 | 125,460.00 | 0.03 |
| 374 | 603979 | 金诚信 | 2,100 | 123,963.00 | 0.03 |
| 375 | 600004 | 白云机场 | 16,900 | 122,694.00 | 0.03 |
| 376 | 601618 | 中国中冶 | 49,900 | 121,756.00 | 0.03 |
| 377 | 603816 | 顾家家居 | 5,400 | 120,744.00 | 0.03 |
| 378 | 300782 | 卓胜微 | 1,100 | 120,538.00 | 0.03 |
| 379 | 300346 | 南大光电 | 1,300 | 120,445.00 | 0.03 |
| 380 | 688072 | 拓荆科技 | 134 | 117,857.02 | 0.02 |
| 381 | 600038 | 中直股份 | 4,500 | 113,805.00 | 0.02 |
| 382 | 688036 | 传音控股 | 1,912 | 112,712.40 | 0.02 |
| 383 | 600438 | 通威股份 | 9,200 | 111,412.00 | 0.02 |
| 384 | 002444 | 巨星科技 | 3,500 | 108,850.00 | 0.02 |
| 385 | 300676 | 华大基因 | 3,100 | 108,686.00 | 0.02 |
| 386 | 002831 | 裕同科技 | 3,022 | 107,462.32 | 0.02 |
| 387 | 000831 | 中国稀土 | 1,900 | 105,431.00 | 0.02 |
| 388 | 002294 | 信立泰 | 3,300 | 105,237.00 | 0.02 |
| 389 | 688017 | 绿的谐波 | 250 | 104,465.00 | 0.02 |
| 390 | 688271 | 联影医疗 | 997 | 100,926.31 | 0.02 |
| 391 | 600673 | 东阳光 | 3,000 | 100,740.00 | 0.02 |
| 392 | 600118 | 中国卫星 | 1,200 | 98,460.00 | 0.02 |
| 393 | 600521 | 华海药业 | 6,800 | 97,920.00 | 0.02 |
| 394 | 002821 | 凯莱英 | 600 | 97,200.00 | 0.02 |
| 395 | 300568 | 星源材质 | 5,100 | 95,472.00 | 0.02 |
| 396 | 688063 | 派能科技 | 1,748 | 93,115.96 | 0.02 |
| 397 | 000426 | 兴业银锡 | 2,800 | 92,288.00 | 0.02 |
| 398 | 600864 | 哈投股份 | 17,300 | 89,787.00 | 0.02 |
| 399 | 603650 | 彤程新材 | 900 | 88,182.00 | 0.02 |
| 400 | 000661 | 长春高新 | 1,300 | 86,580.00 | 0.02 |
| 401 | 601155 | 新城控股 | 8,222 | 84,357.72 | 0.02 |
| 402 | 301358 | 湖南裕能 | 1,100 | 83,457.00 | 0.02 |
| 403 | 000960 | 锡业股份 | 1,900 | 81,111.00 | 0.02 |
| 404 | 300919 | 中伟新材 | 1,800 | 78,750.00 | 0.02 |
| 405 | 601633 | 长城汽车 | 5,200 | 78,468.00 | 0.02 |
| 406 | 002129 | TCL中环 | 6,500 | 78,130.00 | 0.02 |
| 407 | 002572 | 索菲亚 | 10,700 | 78,110.00 | 0.02 |
| 408 | 300015 | 爱尔眼科 | 9,400 | 77,644.00 | 0.02 |
| 409 | 688188 | 柏楚电子 | 723 | 77,144.10 | 0.02 |
| 410 | 000066 | 中国长城 | 4,000 | 76,200.00 | 0.02 |
| 411 | 600096 | 云天化 | 2,500 | 76,000.00 | 0.02 |
| 412 | 600258 | 首旅酒店 | 6,900 | 75,348.00 | 0.02 |
| 413 | 600497 | 驰宏锌锗 | 6,200 | 75,082.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 414 | 300409 | 道氏技术 | 3,700 | 73,741.00 | 0.02 |
| 415 | 688065 | 凯赛生物 | 1,524 | 72,923.40 | 0.02 |
| 416 | 601799 | 星宇股份 | 800 | 72,496.00 | 0.02 |
| 417 | 600221 | 海航控股 | 52,100 | 70,335.00 | 0.01 |
| 418 | 600157 | 永泰能源 | 43,600 | 70,196.00 | 0.01 |
| 419 | 300438 | 鹏辉能源 | 800 | 66,280.00 | 0.01 |
| 420 | 000933 | 神火股份 | 3,100 | 65,720.00 | 0.01 |
| 421 | 002456 | 欧菲光 | 6,700 | 63,382.00 | 0.01 |
| 422 | 605499 | 东鹏饮料 | 490 | 60,480.70 | 0.01 |
| 423 | 002555 | 三七互娱 | 3,200 | 60,384.00 | 0.01 |
| 424 | 600009 | 上海机场 | 2,600 | 60,060.00 | 0.01 |
| 425 | 300458 | 全志科技 | 1,500 | 59,190.00 | 0.01 |
| 426 | 688578 | 艾力斯 | 535 | 58,422.00 | 0.01 |
| 427 | 300339 | 润和软件 | 1,500 | 57,765.00 | 0.01 |
| 428 | 002607 | 中公教育 | 31,500 | 56,700.00 | 0.01 |
| 429 | 000833 | 粤桂股份 | 2,400 | 56,208.00 | 0.01 |
| 430 | 600196 | 复星医药 | 2,500 | 56,175.00 | 0.01 |
| 431 | 002128 | 电投能源 | 2,400 | 55,488.00 | 0.01 |
| 432 | 000768 | 中航西飞 | 2,700 | 55,296.00 | 0.01 |
| 433 | 688331 | 荣昌生物 | 400 | 52,104.00 | 0.01 |
| 434 | 600663 | 陆家嘴 | 8,200 | 51,496.00 | 0.01 |
| 435 | 600859 | 王府井 | 5,600 | 51,408.00 | 0.01 |
| 436 | 300601 | 康泰生物 | 4,500 | 51,030.00 | 0.01 |
| 437 | 301236 | 软通动力 | 1,200 | 50,940.00 | 0.01 |
| 438 | 000963 | 华东医药 | 1,800 | 50,616.00 | 0.01 |
| 439 | 000547 | 航天发展 | 2,600 | 49,790.00 | 0.01 |
| 440 | 000878 | 云南铜业 | 3,000 | 47,640.00 | 0.01 |
| 441 | 300024 | 机器人 | 2,400 | 46,392.00 | 0.01 |
| 442 | 601021 | 春秋航空 | 1,000 | 45,580.00 | 0.01 |
| 443 | 002407 | 多氟多 | 900 | 45,207.00 | 0.01 |
| 444 | 002497 | 雅化集团 | 2,200 | 44,814.00 | 0.01 |
| 445 | 002252 | 上海莱士 | 10,100 | 43,834.00 | 0.01 |
| 446 | 300457 | 赢合科技 | 2,000 | 42,160.00 | 0.01 |
| 447 | 600226 | 亨通股份 | 4,200 | 40,278.00 | 0.01 |
| 448 | 603087 | 甘李药业 | 700 | 39,732.00 | 0.01 |
| 449 | 688169 | 石头科技 | 412 | 39,127.64 | 0.01 |
| 450 | 603606 | 东方电缆 | 900 | 37,359.00 | 0.01 |
| 451 | 600516 | 方大炭素 | 5,600 | 34,552.00 | 0.01 |
| 452 | 300699 | 光威复材 | 1,200 | 34,380.00 | 0.01 |
| 453 | 002176 | 江特电机 | 3,400 | 34,034.00 | 0.01 |
| 454 | 000623 | 吉林敖东 | 1,900 | 33,687.00 | 0.01 |
| 455 | 605090 | 九丰能源 | 900 | 33,453.00 | 0.01 |
| 456 | 002085 | 万丰奥威 | 3,000 | 33,270.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 457 | 000617 | 中油资本 | 5,000 | 32,950.00 | 0.01 |
| 458 | 300342 | 天银机电 | 700 | 32,900.00 | 0.01 |
| 459 | 300558 | 贝达药业 | 500 | 32,535.00 | 0.01 |
| 460 | 002459 | 晶澳科技 | 4,000 | 32,400.00 | 0.01 |
| 461 | 300251 | 光线传媒 | 2,900 | 32,161.00 | 0.01 |
| 462 | 600655 | 豫园股份 | 7,800 | 32,058.00 | 0.01 |
| 463 | 688005 | 容百科技 | 1,016 | 31,089.60 | 0.01 |
| 464 | 603605 | 珀莱雅 | 500 | 29,960.00 | 0.01 |
| 465 | 603766 | 隆鑫通用 | 2,500 | 29,825.00 | 0.01 |
| 466 | 603260 | 合盛硅业 | 600 | 28,956.00 | 0.01 |
| 467 | 300122 | 智飞生物 | 2,400 | 28,056.00 | 0.01 |
| 468 | 600153 | 建发股份 | 3,500 | 27,755.00 | 0.01 |
| 469 | 301550 | 斯菱智驱 | 300 | 27,429.00 | 0.01 |
| 470 | 300896 | 爱美客 | 300 | 26,160.00 | 0.01 |
| 471 | 688114 | 华大智造 | 502 | 25,642.16 | 0.01 |
| 472 | 603486 | 科沃斯 | 500 | 25,375.00 | 0.01 |
| 473 | 603568 | 伟明环保 | 1,640 | 25,223.20 | 0.01 |
| 474 | 002389 | 航天彩虹 | 1,400 | 24,878.00 | 0.01 |
| 475 | 600323 | 瀚蓝环境 | 900 | 24,714.00 | 0.01 |
| 476 | 600820 | 隧道股份 | 4,500 | 23,445.00 | 0.00 |
| 477 | 600161 | 天坛生物 | 2,000 | 23,160.00 | 0.00 |
| 478 | 300118 | 东方日升 | 1,800 | 22,410.00 | 0.00 |
| 479 | 603392 | 万泰生物 | 800 | 21,576.00 | 0.00 |
| 479 | 603939 | 益丰药房 | 1,200 | 21,576.00 | 0.00 |
| 480 | 601880 | 辽港股份 | 14,700 | 20,286.00 | 0.00 |
| 481 | 300573 | 兴齐眼药 | 490 | 19,972.40 | 0.00 |
| 482 | 300100 | 双林股份 | 700 | 19,446.00 | 0.00 |
| 483 | 300347 | 泰格医药 | 400 | 19,200.00 | 0.00 |
| 484 | 300144 | 宋城演艺 | 3,200 | 18,592.00 | 0.00 |
| 485 | 603899 | 晨光股份 | 900 | 18,567.00 | 0.00 |
| 486 | 000998 | 隆平高科 | 2,300 | 17,342.00 | 0.00 |
| 487 | 600635 | 大众公用 | 3,900 | 16,692.00 | 0.00 |
| 488 | 002544 | 普天科技 | 900 | 16,398.00 | 0.00 |
| 489 | 002091 | 江苏国泰 | 1,900 | 13,737.00 | 0.00 |
| 490 | 300070 | 碧水源 | 4,200 | 13,398.00 | 0.00 |
| 491 | 000069 | 华侨城A | 7,900 | 12,956.00 | 0.00 |
| 492 | 301078 | 孩子王 | 1,800 | 12,168.00 | 0.00 |
| 493 | 603833 | 欧派家居 | 400 | 12,044.00 | 0.00 |
| 494 | 002292 | 奥飞娱乐 | 1,800 | 11,808.00 | 0.00 |
| 495 | 002891 | 中宠股份 | 300 | 8,016.00 | 0.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688037 | 芯源微 | 5,243 | 2,301,939.15 | 0.48 |
| 2 | 688172 | 燕东微 | 22,576 | 1,888,708.16 | 0.40 |
| 3 | 688630 | 芯碁微装 | 3,201 | 1,758,597.39 | 0.37 |
| 4 | 688300 | 联瑞新材 | 6,133 | 1,498,905.20 | 0.31 |
| 5 | 002142 | 宁波银行 | 50,000 | 1,484,500.00 | 0.31 |
| 6 | 603308 | 应流股份 | 21,300 | 1,286,520.00 | 0.27 |
| 7 | 000959 | 首钢股份 | 324,400 | 1,138,644.00 | 0.24 |
| 8 | 002484 | 江海股份 | 10,800 | 1,134,000.00 | 0.24 |
| 9 | 600301 | 华锡有色 | 17,500 | 1,073,100.00 | 0.23 |
| 10 | 601688 | 华泰证券 | 44,200 | 911,404.00 | 0.19 |
| 11 | 688433 | 华曙高科 | 10,646 | 911,297.60 | 0.19 |
| 12 | 601939 | 建设银行 | 91,900 | 884,997.00 | 0.19 |
| 13 | 002409 | 雅克科技 | 3,900 | 875,550.00 | 0.18 |
| 14 | 601077 | 渝农商行 | 141,100 | 862,121.00 | 0.18 |
| 15 | 600926 | 杭州银行 | 55,000 | 794,750.00 | 0.17 |
| 16 | 301611 | 珂玛科技 | 4,300 | 774,301.00 | 0.16 |
| 17 | 002020 | 京新药业 | 60,900 | 760,641.00 | 0.16 |
| 18 | 688301 | 奕瑞科技 | 5,769 | 715,356.00 | 0.15 |
| 19 | 688068 | 热景生物 | 7,921 | 685,958.60 | 0.14 |
| 20 | 688220 | 翱捷科技 | 5,247 | 652,307.04 | 0.14 |
| 21 | 688545 | 兴福电子 | 4,874 | 648,534.44 | 0.14 |
| 22 | 301526 | 国际复材 | 13,800 | 644,046.00 | 0.14 |
| 23 | 603296 | 华勤技术 | 8,400 | 623,868.00 | 0.13 |
| 24 | 688141 | 杰华特 | 4,060 | 623,210.00 | 0.13 |
| 25 | 300570 | 太辰光 | 2,500 | 616,775.00 | 0.13 |
| 26 | 603678 | 火炬电子 | 7,400 | 614,200.00 | 0.13 |
| 27 | 603267 | 鸿远电子 | 7,900 | 612,092.00 | 0.13 |
| 28 | 000983 | 山西焦煤 | 105,300 | 610,740.00 | 0.13 |
| 29 | 000776 | 广发证券 | 25,600 | 599,040.00 | 0.13 |
| 30 | 688766 | 普冉股份 | 780 | 597,948.00 | 0.13 |
| 31 | 688409 | 富创精密 | 1,939 | 593,818.75 | 0.12 |
| 32 | 600338 | 西藏珠峰 | 38,500 | 586,740.00 | 0.12 |
| 33 | 688519 | 南亚新材 | 1,542 | 586,021.68 | 0.12 |
| 34 | 600809 | 山西汾酒 | 4,900 | 535,913.00 | 0.11 |
| 35 | 000729 | 燕京啤酒 | 49,800 | 504,474.00 | 0.11 |
| 36 | 600919 | 江苏银行 | 44,600 | 480,788.00 | 0.10 |
| 37 | 301269 | 华大九天 | 4,000 | 477,680.00 | 0.10 |
| 38 | 301666 | 大普微 | 976 | 452,210.08 | 0.09 |
| 39 | 601126 | 四方股份 | 6,900 | 436,080.00 | 0.09 |
| 40 | 603156 | 养元饮品 | 8,800 | 431,816.00 | 0.09 |
| 41 | 301217 | 铜冠铜箔 | 2,500 | 412,675.00 | 0.09 |
| 42 | 000703 | 恒逸石化 | 29,000 | 393,530.00 | 0.08 |
| 43 | 601336 | 新华保险 | 5,800 | 346,028.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 44 | 688206 | 概伦电子 | 7,605 | 337,433.85 | 0.07 |
| 45 | 002149 | 西部材料 | 6,200 | 334,862.00 | 0.07 |
| 46 | 301165 | 锐捷网络 | 4,100 | 329,845.00 | 0.07 |
| 47 | 603225 | 新凤鸣 | 16,700 | 328,155.00 | 0.07 |
| 48 | 601003 | 柳钢股份 | 96,700 | 325,879.00 | 0.07 |
| 49 | 688668 | 鼎通科技 | 869 | 324,397.70 | 0.07 |
| 50 | 301536 | 星宸科技 | 2,400 | 308,904.00 | 0.06 |
| 51 | 002929 | 润建股份 | 4,600 | 307,648.00 | 0.06 |
| 52 | 600563 | 法拉电子 | 1,600 | 305,280.00 | 0.06 |
| 53 | 688351 | 微电生理 | 13,332 | 302,103.12 | 0.06 |
| 54 | 688183 | 生益电子 | 2,273 | 300,945.20 | 0.06 |
| 55 | 688025 | 杰普特 | 636 | 298,920.00 | 0.06 |
| 56 | 300687 | 赛意信息 | 9,600 | 297,600.00 | 0.06 |
| 57 | 002158 | 汉钟精机 | 8,000 | 296,640.00 | 0.06 |
| 58 | 301000 | 肇民科技 | 9,200 | 294,492.00 | 0.06 |
| 59 | 688627 | 精智达 | 411 | 293,865.00 | 0.06 |
| 60 | 688336 | 三生国健 | 5,501 | 292,103.10 | 0.06 |
| 61 | 688652 | 京仪装备 | 1,458 | 291,847.86 | 0.06 |
| 62 | 688353 | 华盛锂电 | 2,512 | 291,567.84 | 0.06 |
| 63 | 300416 | 苏试试验 | 14,300 | 291,434.00 | 0.06 |
| 64 | 688006 | 杭可科技 | 7,968 | 291,230.40 | 0.06 |
| 65 | 601696 | 中银证券 | 22,800 | 288,420.00 | 0.06 |
| 66 | 301511 | 德福科技 | 2,000 | 287,700.00 | 0.06 |
| 67 | 301381 | 赛维时代 | 15,500 | 285,820.00 | 0.06 |
| 68 | 603063 | 禾望电气 | 5,400 | 285,606.00 | 0.06 |
| 69 | 300723 | 一品红 | 7,600 | 283,328.00 | 0.06 |
| 70 | 300373 | 扬杰科技 | 1,800 | 283,014.00 | 0.06 |
| 71 | 600391 | 航发科技 | 8,400 | 280,980.00 | 0.06 |
| 71 | 601611 | 中国核建 | 25,200 | 280,980.00 | 0.06 |
| 72 | 300870 | 欧陆通 | 800 | 276,552.00 | 0.06 |
| 73 | 601958 | 金钼股份 | 9,800 | 275,478.00 | 0.06 |
| 74 | 301377 | 鼎泰高科 | 500 | 275,450.00 | 0.06 |
| 75 | 601699 | 潞安环能 | 19,000 | 271,320.00 | 0.06 |
| 76 | 605376 | 博迁新材 | 1,000 | 271,300.00 | 0.06 |
| 77 | 688029 | 南微医学 | 3,624 | 260,203.20 | 0.05 |
| 78 | 601636 | 旗滨集团 | 25,300 | 258,819.00 | 0.05 |
| 79 | 002043 | 兔 宝 宝 | 21,100 | 233,788.00 | 0.05 |
| 80 | 000672 | 上峰材料 | 9,800 | 232,064.00 | 0.05 |
| 81 | 600507 | 方大特钢 | 54,400 | 220,320.00 | 0.05 |
| 82 | 001248 | 华润新能源 | 21,138 | 213,705.18 | 0.04 |
| 83 | 600999 | 招商证券 | 9,500 | 200,450.00 | 0.04 |
| 84 | 301087 | 可孚医疗 | 4,100 | 195,365.00 | 0.04 |
| 85 | 688375 | 国博电子 | 1,813 | 189,095.90 | 0.04 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 86 | 600869 | 远东股份 | 5,500 | 184,085.00 | 0.04 |
| 87 | 000719 | 中原传媒 | 16,000 | 182,880.00 | 0.04 |
| 88 | 300613 | 富瀚微 | 2,200 | 176,176.00 | 0.04 |
| 89 | 688809 | 强一股份 | 259 | 161,357.00 | 0.03 |
| 90 | 600246 | 万通发展 | 7,800 | 148,200.00 | 0.03 |
| 91 | 600958 | 东方证券 | 15,600 | 147,264.00 | 0.03 |
| 92 | 601128 | 常熟银行 | 25,040 | 145,732.80 | 0.03 |
| 93 | 600808 | 马钢股份 | 57,400 | 143,500.00 | 0.03 |
| 94 | 601900 | 南方传媒 | 12,300 | 133,578.00 | 0.03 |
| 95 | 600021 | 上海电力 | 8,800 | 132,616.00 | 0.03 |
| 96 | 688820 | 盛合晶微 | 929 | 131,444.21 | 0.03 |
| 97 | 002215 | 诺 普 信 | 15,700 | 129,211.00 | 0.03 |
| 98 | 688818 | 电科蓝天 | 1,717 | 120,430.38 | 0.03 |
| 99 | 002840 | 华统股份 | 15,900 | 115,911.00 | 0.02 |
| 100 | 603306 | 华懋科技 | 1,100 | 114,059.00 | 0.02 |
| 101 | 600025 | 华能水电 | 12,800 | 113,792.00 | 0.02 |
| 102 | 688016 | 心脉医疗 | 1,274 | 112,927.36 | 0.02 |
| 103 | 603099 | 长白山 | 2,800 | 99,876.00 | 0.02 |
| 104 | 301682 | 宏明电子 | 615 | 98,436.90 | 0.02 |
| 105 | 300770 | 新媒股份 | 3,000 | 94,470.00 | 0.02 |
| 106 | 603179 | 新泉股份 | 1,900 | 94,335.00 | 0.02 |
| 107 | 688797 | 臻宝科技 | 196 | 91,859.32 | 0.02 |
| 108 | 300482 | 万孚生物 | 5,500 | 91,355.00 | 0.02 |
| 109 | 301510 | 固高科技 | 2,800 | 89,404.00 | 0.02 |
| 110 | 002739 | 儒意电影 | 8,700 | 83,520.00 | 0.02 |
| 111 | 688795 | 摩尔线程 | 114 | 81,679.86 | 0.02 |
| 112 | 002311 | 海大集团 | 1,800 | 80,298.00 | 0.02 |
| 113 | 600389 | 江山股份 | 4,100 | 80,032.00 | 0.02 |
| 114 | 688050 | 爱博医疗 | 2,132 | 77,711.40 | 0.02 |
| 115 | 300761 | 立华股份 | 4,600 | 75,486.00 | 0.02 |
| 116 | 600188 | 兖矿能源 | 4,200 | 74,634.00 | 0.02 |
| 117 | 001399 | 惠科股份 | 2,511 | 69,630.03 | 0.01 |
| 118 | 600710 | 苏美达 | 7,000 | 66,920.00 | 0.01 |
| 119 | 301363 | 美好医疗 | 3,580 | 65,621.40 | 0.01 |
| 120 | 600641 | 先导基电 | 1,600 | 63,776.00 | 0.01 |
| 121 | 601898 | 中煤能源 | 5,100 | 62,118.00 | 0.01 |
| 122 | 688192 | 迪哲医药 | 1,511 | 60,334.23 | 0.01 |
| 123 | 600060 | 海信视像 | 2,000 | 55,740.00 | 0.01 |
| 124 | 688785 | 恒运昌 | 116 | 53,725.40 | 0.01 |
| 125 | 688807 | 优迅股份 | 131 | 52,718.33 | 0.01 |
| 126 | 002429 | 兆驰股份 | 5,000 | 51,950.00 | 0.01 |
| 127 | 000059 | 华锦股份 | 13,300 | 49,875.00 | 0.01 |
| 128 | 601918 | 新集能源 | 5,800 | 49,822.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 129 | 688813 | 泰金新能 | 234 | 40,269.06 | 0.01 |
| 130 | 688635 | 长进光子 | 128 | 39,448.32 | 0.01 |
| 131 | 001257 | 盛龙股份 | 1,743 | 36,149.82 | 0.01 |
| 132 | 605599 | 菜百股份 | 2,600 | 35,620.00 | 0.01 |
| 133 | 301216 | 万凯新材 | 1,500 | 34,485.00 | 0.01 |
| 134 | 600729 | 重百集团 | 1,800 | 33,804.00 | 0.01 |
| 135 | 603920 | 世运电路 | 700 | 33,628.00 | 0.01 |
| 136 | 002701 | 奥瑞金 | 7,100 | 30,246.00 | 0.01 |
| 137 | 600546 | 山煤国际 | 2,600 | 28,418.00 | 0.01 |
| 138 | 603459 | 红板科技 | 330 | 27,825.60 | 0.01 |
| 139 | 002832 | 比音勒芬 | 1,000 | 20,640.00 | 0.00 |
| 140 | 001365 | 天海电子 | 657 | 20,570.67 | 0.00 |
| 141 | 688811 | 有研复材 | 834 | 20,124.42 | 0.00 |
| 142 | 002345 | 潮宏基 | 2,100 | 19,257.00 | 0.00 |
| 143 | 301696 | 三瑞智能 | 216 | 18,748.80 | 0.00 |
| 144 | 002003 | 伟星股份 | 2,200 | 18,524.00 | 0.00 |
| 145 | 001237 | 惠康科技 | 274 | 16,094.76 | 0.00 |
| 146 | 301669 | 高特电子 | 546 | 15,506.40 | 0.00 |
| 147 | 301687 | 新广益 | 195 | 15,167.10 | 0.00 |
| 148 | 001393 | 维通利 | 387 | 15,089.13 | 0.00 |
| 149 | 301531 | 春光集团 | 290 | 14,952.40 | 0.00 |
| 150 | 301599 | 理奇智能 | 433 | 14,059.51 | 0.00 |
| 151 | 301680 | 固德电材 | 117 | 13,122.72 | 0.00 |
| 152 | 601112 | 振石股份 | 742 | 13,051.78 | 0.00 |
| 153 | 688805 | 健信超导 | 265 | 12,447.05 | 0.00 |
| 154 | 001369 | 双欣材料 | 897 | 12,127.44 | 0.00 |
| 155 | 301683 | 慧谷新材 | 96 | 11,689.92 | 0.00 |
| 156 | 688781 | 视涯科技 | 215 | 10,236.15 | 0.00 |
| 157 | 688816 | 易思维 | 177 | 10,106.70 | 0.00 |
| 158 | 688712 | 北芯生命 | 234 | 8,405.28 | 0.00 |
| 159 | 603919 | 金徽酒 | 400 | 6,020.00 | 0.00 |
| 160 | 603435 | 嘉德利 | 104 | 4,857.84 | 0.00 |
| 161 | 001396 | 誉帆科技 | 69 | 2,443.98 | 0.00 |
| 162 | 603293 | 埃泰克 | 72 | 2,442.96 | 0.00 |
| 163 | 001312 | 福恩股份 | 134 | 2,248.52 | 0.00 |
| 164 | 603284 | 林平发展 | 46 | 1,604.02 | 0.00 |
| 165 | 001220 | 世盟股份 | 57 | 1,583.46 | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601677 | 明泰铝业 | 9,047,700.00 | 1.00 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 8,279,720.00 | 0.91 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3 | 000807 | 云铝股份 | 7,798,372.25 | 0.86 |
| 4 | 002916 | 深南电路 | 7,285,243.36 | 0.80 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 7,015,755.00 | 0.77 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 6,479,436.00 | 0.72 |
| 7 | 300308 | 中际旭创 | 6,298,795.00 | 0.70 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 6,289,926.00 | 0.69 |
| 9 | 688981 | 中芯国际 | 6,243,764.79 | 0.69 |
| 10 | 000933 | 神火股份 | 5,572,304.00 | 0.62 |
| 11 | 000338 | 潍柴动力 | 5,367,554.86 | 0.59 |
| 12 | 300502 | 新易盛 | 5,278,968.00 | 0.58 |
| 13 | 300972 | 万辰集团 | 5,206,144.00 | 0.57 |
| 14 | 601600 | 中国铝业 | 5,168,465.00 | 0.57 |
| 15 | 688041 | 海光信息 | 5,118,343.13 | 0.57 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 4,971,239.00 | 0.55 |
| 17 | 601899 | 紫金矿业 | 4,790,737.67 | 0.53 |
| 18 | 002463 | 沪电股份 | 4,788,949.00 | 0.53 |
| 19 | 601288 | 农业银行 | 4,548,551.00 | 0.50 |
| 20 | 688012 | 中微公司 | 4,542,465.80 | 0.50 |

注："买入金额"按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 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 | 300750 | 宁德时代 | 25,116,110.62 | 2.77 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 21,730,857.00 | 2.40 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 19,075,459.00 | 2.11 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 18,696,857.00 | 2.06 |
| 5 | 300308 | 中际旭创 | 16,026,594.00 | 1.77 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 11,822,678.00 | 1.31 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 11,679,834.21 | 1.29 |
| 8 | 300502 | 新易盛 | 11,623,804.00 | 1.28 |
| 9 | 688041 | 海光信息 | 11,312,078.11 | 1.25 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 10,781,844.00 | 1.19 |
| 11 | 600988 | 赤峰黄金 | 9,409,259.00 | 1.04 |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 8,930,775.00 | 0.99 |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 8,867,259.00 | 0.98 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 8,538,272.58 | 0.94 |
| 15 | 688981 | 中芯国际 | 8,456,502.92 | 0.93 |
| 16 | 002475 | 立讯精密 | 8,202,386.00 | 0.91 |
| 17 | 300274 | 阳光电源 | 8,157,278.00 | 0.90 |
| 18 | 601677 | 明泰铝业 | 8,110,959.62 | 0.90 |
| 19 | 688256 | 寒武纪 | 8,024,675.91 | 0.89 |
| 20 | 002371 | 北方华创 | 7,978,534.00 | 0.88 |

注："卖出金额"按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 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 | 978,948,283.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,460,544,472.68 |

注："买入股票成本总额"和"卖出股票收入总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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

本基金本报告期未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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之外的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 332,865.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 332,865.69 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## §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（%） |
| 银华中证A500指数增强A | 1,062 | 172,537.38 | 19,975,206.61 | 10.90 | 163,259,488.57 | 89.10 |
| 银华中证A500指数增强C | 1,878 | 126,133.35 | 16,401,602.17 | 6.92 | 220,476,823.94 | 93.08 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 合计 | 2,940 | 142,895.62 | 36,376,808.78 | 8.66 | 383,736,312.51 | 91.34 |

注：对于分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算当中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 银华中证 A500 指数增强 A | 29,890.49 | 0.02 |
| | 银华中证 A500 指数增强 C | 500,333.38 | 0.21 |
| | 合计 | 530,223.87 | 0.13 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 银华中证 A500 指数增强 A | - |
| | 银华中证 A500 指数增强 C | - |
| | 合计 | - |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 银华中证 A500 指数增强 A | 0~10 |
| | 银华中证 A500 指数增强 C | - |
| | 合计 | 0~10 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 银华中证 A500 指数增强 A | 银华中证 A500 指数增强 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2025 年 9 月 16 日）基金份额总额 | 484,865,293.99 | 655,651,619.05 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 376,184,644.76 | 513,776,443.01 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,875,282.78 | 30,384,221.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 202,825,232.36 | 307,282,238.80 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 183,234,695.18 | 236,878,426.11 |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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，无基金份额持有人大会决议。

## 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

## 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

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 招商证券 | 3 | 2,437,326,050.62 | 100.00 | 355,603.63 | 100.00 | - |

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）

具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

### 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(%) |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |

## 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 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的湖南黄金估值方法调整的公告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报 | 2026 年 1 月 16 日 |
| 2 | 《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 1 月 21 日 |
| 3 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》 | 四大证券报 | 2026 年 1 月 21 日 |
| 4 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的赤峰黄金估值方法调整的公告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报 | 2026 年 3 月 21 日 |
| 5 | 《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 6 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告》 | 四大证券报 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 7 | 《银华中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 4 月 21 日 |
| 8 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部 | 四大证券报 | 2026 年 4 月 21 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 分基金2026年第1季度报告提示性公告》 | | |
| 9 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的拓荆科技估值方法调整的公告》 | 本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报 | 2026年6月30日 |

# §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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过20%的单一投资者的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证A500指数增强型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2《银华中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》

12.1.3《银华中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》

12.1.4《银华中证A500指数增强型证券投资基金托管协议》

12.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

## 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

## 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

**银华基金管理股份有限公司**

**2026年8月29日**