

银华中证 800 增强策略交易型开放式指数  
证券投资基金  
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 26 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。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	15
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	63
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	63
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	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>65</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>70</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	800 增强 ETF
场内简称	中证 800 增强 ETF 银华
基金主代码	159517
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 23 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	8,742,624.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，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	<p>本基金采用指数增强投资策略，主要包括（1）指数化投资策略：本基金指数化投资以标的指数的成份股组成及其权重为基础，确定本基金投资组合的基本构成和大致权重，并通过控制投资组合中个股权重对标的指数成份股权重的偏离，实现对标的指数的跟踪和对跟踪误差的控制。</p> <p>（2）量化增强投资策略：本基金将在力争有效控制风险及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，并在全市场优先选择综合评估价值较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整，以争取实现指数增强的目标。</p> <p>建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
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。本基金为指数型基金，采用指数增强投资策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	2024 年	2023 年 8 月 23 日（基金合同生效日）- 2023 年 12 月 31 日
	本期已实现收益	2,462,153.69	2,391,537.52
本期利润	2,692,102.95	2,999,151.62	-1,596,849.36
加权平均基金份额本期利润	0.2076	0.1229	-0.0232
本期加权平均净值利润率	18.38%	12.84%	-2.36%
本期基金份额净值增长率	19.34%	16.00%	-6.86%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	2,530,184.20	1,185,503.35	-2,658,869.09
期末可供分配基金份额利润	0.2894	0.0804	-0.0686

期末基金资产净值	11,272,808.20	15,928,127.35	36,083,754.91
期末基金份额净值	1.2894	1.0804	0.9314
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	28.94%	8.04%	-6.86%

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

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	2.35%	0.97%	0.02%	1.01%	2.33%	-0.04%
过去六个月	17.54%	0.88%	19.85%	0.96%	-2.31%	-0.08%
过去一年	19.34%	0.94%	20.89%	1.02%	-1.55%	-0.08%
自基金合同生效起至今	28.94%	1.08%	24.98%	1.18%	3.96%	-0.10%

### 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

800增强ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

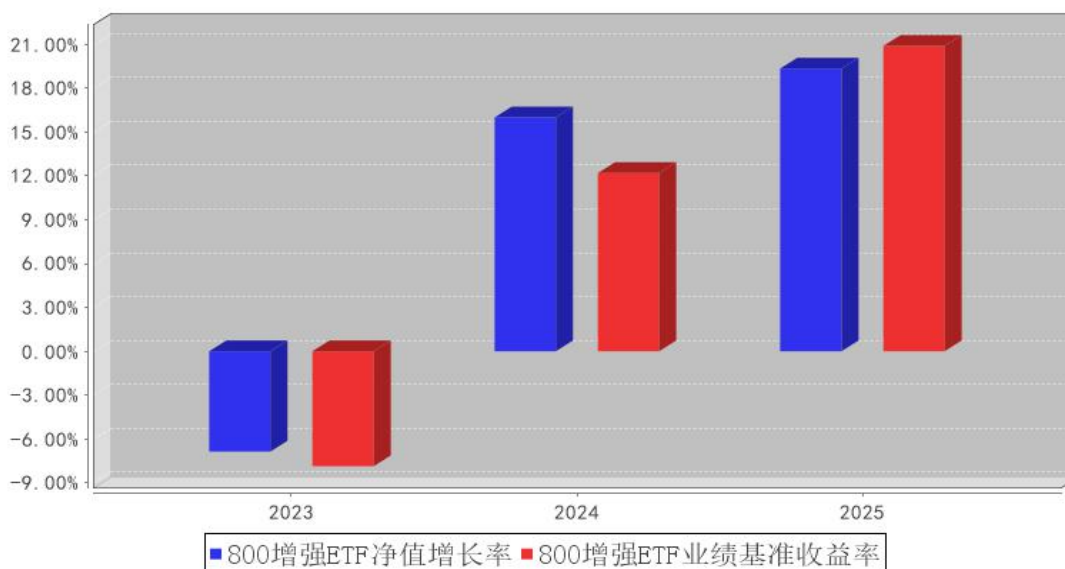


注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各

项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

### 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

800增强ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2023年08月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日止会计期间、2024年度及2025年度未进行利润分配。

## § 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

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2025年底，银华基金管理公募基金242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 年起连续五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		
张凯先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 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/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

					<p>(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。</p>
王帅先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 日	2025 年 10 月 23 日	13.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工

			日	<p>银瑞信投资管理有限公司，2018年8月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2019年6月28日至2021年2月25日担任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年11月1日至2021年5月19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2019年12月6日至2021年2月25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1月22日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年3月20日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年5月28日至2023年4月12日兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2020年12月10日至2022年6月20日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年1月5日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月3日至2022年6月20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2月4日起兼任银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月9日至2022年6月20日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月3日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月10日至2022年6月20日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年4月29日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年6月29日起兼任银华中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年10月26日至2023年4月6日兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年12月7日至2023年7月28日兼任银华中证细分化工产业主题</p>
--	--	--	---	---

				<p>交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 30 日起兼任银华中证创新药产业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 2022 年 1 月 4 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 18 日至 2023 年 3 月 17 日兼任银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 30 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 26 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 8 月 23 日至 2025 年 10 月 23 日兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 25 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2024 年 3 月 6 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 1 月 17 日起兼任银华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 17 日至 2025 年 2 月 4 日兼任银华上证 180 指数型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 5 日起兼任银华上证 180 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 2025 年 4 月 9 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 8 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 8 月 29 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开</p>
--	--	--	--	---

					放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,自2026年1月28日起兼任银华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2023年8月23日	2025年10月22日	12年	大学本科。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013年7月加入银华基金。现任量化投资部基金经理。自2025年12月5日起担任银华中证高股息策略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2026年2月10日起兼任银华中证科创创业50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。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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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800增强策略交易型开放式指数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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决

策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 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《证券投资基金管理人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四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。

#### 4.3.3 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%的情况有2次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 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

2025年国内外宏观经济运行呈现出一些新的特征。国内方面，宏观经济继续呈现整体复苏与结构调整态势，新质经济驱动力提升。在消费品国补等政策支撑下，内需消费整体平稳；房地产产业链复苏较弱。此外，AI、科技硬件、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品，体现出新经济的活力提升。国外方面，美联储在降息通道中继续前行，全年三次降低基准利率；而另一方面，全球主要经济体之间的关税贸易政策框架在博弈中渐进成型，不确定性有所收敛但仍存变数。在上述因素的作用下，A股市场主要指数在2025年明显上行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2894元；本报告期基金份额净值增长率为19.34%，业绩比较基准收益率为20.89%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在6.5%以内。

### 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，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的波动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，国内政策、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续观察。

#### 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，基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，根据法律法规、监管规定和业务发展的需要，持续健全合规管理及监察稽核机制，改进合规管理方式，提高合规管理能力，推进合规文化建设，提升合规管理工作的有效性。

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实基于风险的反洗钱理念，健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处置业务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱等方面的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

#### 4.7 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验。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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 4 月 19 日至 2025 年 12 月 31 日。报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 12 月 6 日至 2025 年 3 月 3 日、2025 年 3 月 10 日至 2025 年 5 月 15 日、2025 年 5 月 28 日至 2025 年 8 月 13 日、2025 年 9 月 12 日至 2025 年 11 月 25 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。自 2024 年 7 月 18 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

## § 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z1133 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“800 增强 ETF”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 800 增强 ETF 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于 800 增强 ETF，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>800 增强 ETF 的基金管理人银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估 800 增强 ETF 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，除非基金管理人管理层计划清算 800 增强 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	基金管理人治理层负责监督 800 增强 ETF 的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价基金管理人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。</p> <p>(4) 对基金管理人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 800 增强 ETF 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 800 增强 ETF 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、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。</p> <p>我们与基金管理人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。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	陈玉珊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
审计报告日期	2026 年 03 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	505,683.99	654,598.26
结算备付金		24,114.10	72,882.75
存出保证金		1,537.06	2,617.11
交易性金融资产	7.4.7.2	10,712,924.24	15,233,491.73
其中: 股票投资		10,712,924.24	15,233,491.73
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		81,840.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	1,710.00	880.00
资产总计		11,327,809.91	15,964,469.85
<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>上年度末 2024 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		45,761.69	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,672.96	7,043.75
应付托管费		934.57	1,408.74
应付销售服务费		-	-
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	7.4.7.9	3,632.49	27,890.01
负债合计		55,001.71	36,342.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	8,742,624.00	14,742,624.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,530,184.20	1,185,503.35
净资产合计		11,272,808.20	15,928,127.35
负债和净资产总计		11,327,809.91	15,964,469.85

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2894 元，基金份额总额 8,742,624.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		2,779,630.45	3,154,576.93
1. 利息收入		2,222.98	7,148.01
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,222.98	7,148.01
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）		2,539,315.23	2,470,165.18
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,195,381.33	1,912,246.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	343,933.90	557,919.18
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）	7.4.7.20	229,949.26	607,614.10
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.21	8,142.98	69,649.64
<b>减: 二、营业总支出</b>		87,527.50	155,425.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	72,938.46	116,784.33
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,587.54	23,356.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	1.50	15,284.03
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		2,692,102.95	2,999,151.62
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		2,692,102.95	2,999,151.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,692,102.95	2,999,151.62

### 7.3 净资产变动表

会计主体: 银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	14,742,624.00	-	1,185,503.35	15,928,127.35
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,742,624.00	-	1,185,503.35	15,928,127.35
三、本期增减变动额 (减少以	-6,000,000.00	-	1,344,680.85	-4,655,319.15

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	2,692,102.95	2,692,102.95
(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)	-6,000,000.00	-	-1,347,422.10	-7,347,422.10
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-	-1,347,422.10	-7,347,422.10
(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	8,742,624.00	-	2,530,184.20	11,272,808.20
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	38,742,624.00	-	-2,658,869.09	36,083,754.91
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,742,624.00	-	-2,658,869.09	36,083,754.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-	3,844,372.44	-20,155,627.56
(一)、综合收益总额	-	-	2,999,151.62	2,999,151.62
(二)、本期基金份额交易产	-24,000,000.00	-	845,220.82	-23,154,779.18

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	75,000,000.00	-	-5,113,044.05	69,886,955.95
2. 基金赎回款	-99,000,000.00	-	5,958,264.87	-93,041,735.13
（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	14,742,624.00	-	1,185,503.35	15,928,127.35

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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[2023]1419 号《关于准予银华中证 800 增强策略交易型开放式指数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 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 245,731,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0421 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2023 年 8 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 245,742,624.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,624.00 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” )。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]810号核准,本基金245,742,624.00份基金份额于2023年9月5日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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。同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权)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。本基金可以根据相关法律法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于2026年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年度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2025年12月31日的财务状况以及2025年度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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

### 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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 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[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]36号《关于全面推开营业税改征增值税

试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，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。

(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。

(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。

## 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	
	上年度末	
	2024年12月31日	
活期存款	505,683.99	654,598.26
等于：本金	505,630.57	654,524.66
加：应计利息	53.42	73.60
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	505,683.99	654,598.26

## 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	10,183,249.90	-	10,712,924.24	529,674.34
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	10,183,249.90	-	10,712,924.24	529,674.34
项目	上年度末			
	2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,933,766.65	-	15,233,491.73	299,725.08

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	14,933,766.65	-	15,233,491.73	299,725.08

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

#### 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

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 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

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	1,710.00	880.00
待摊费用	-	-
合计	1,710.00	880.00

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	3,632.49	7,831.36
其中：交易所市场	3,632.49	7,831.36
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	20,058.65
合计	3,632.49	27,890.01

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,742,624.00	14,742,624.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	8,742,624.00	8,742,624.00
-----	--------------	--------------

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,284,879.85	-99,376.50	1,185,503.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,284,879.85	-99,376.50	1,185,503.35
本期利润	2,462,153.69	229,949.26	2,692,102.95
本期基金份额交易产生的变动数	-1,102,888.16	-244,533.94	-1,347,422.10
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,102,888.16	-244,533.94	-1,347,422.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,644,145.38	-113,961.18	2,530,184.20

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	2,079.56	4,184.64
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	136.13	2,530.44
其他	7.29	432.93
合计	2,222.98	7,148.01

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,951,795.11	2,163,207.56
股票投资收益——赎回差价收入	243,586.22	-250,961.56

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	2,195,381.33	1,912,246.00

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出股票成交总 额	61,357,123.29	166,338,328.15
减：卖出股票成本 总额	59,349,873.97	163,980,773.17
减：交易费用	55,454.21	194,347.42
买卖股票差价收 入	1,951,795.11	2,163,207.56

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
赎回基金份额对价总 额	7,347,422.10	93,041,735.13
减：现金支付赎回款 总额	4,938,838.10	64,780,836.13
减：赎回股票成本总 额	2,164,997.78	28,511,860.56
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	243,586.22	-250,961.56

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月	2024年1月1日至2024年12月

	31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	343,933.90	557,919.18
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	343,933.90	557,919.18

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	229,949.26	607,614.10
股票投资	229,949.26	607,614.10
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	229,949.26	607,614.10

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	8,142.98	69,649.64
合计	8,142.98	69,649.64

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	-	2,718.58

信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	-	1,687.95
其他	1.50	10,877.50
合计	1.50	15,284.03

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）
西南证券	4,300,338.59	3.64	-	-

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
西南证券	627.55	3.64	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	72,938.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,875.03	5,496.93
应支付基金管理人的净管理费	64,063.43	111,287.40

注：支付基金管理人银华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50%/ 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,587.54	23,356.95

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 0.10% 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 X 0.10%/ 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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

注：无。

#### 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

注：无。

##### 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

注：无。

#### 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

注：无。

##### 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

注：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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	505,683.99	2,079.56	654,598.26	4,184.64

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

自 2024 年 7 月 18 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 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

注：无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 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

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

#### 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	505,683.99	-	-	-	505,683.99
结算备付金	24,114.10	-	-	-	24,114.10
存出保证金	1,537.06	-	-	-	1,537.06
交易性金融资产	-	-	-	10,712,924.24	10,712,924.24
应收清算款	-	-	-	81,840.52	81,840.52
其他资产	-	-	-	1,710.00	1,710.00
资产总计	531,335.15	-	-	10,796,474.76	11,327,809.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,672.96	4,672.96
应付托管费	-	-	-	934.57	934.57
应付清算款	-	-	-	45,761.69	45,761.69
其他负债	-	-	-	3,632.49	3,632.49
负债总计	-	-	-	55,001.71	55,001.71
利率敏感度缺口	531,335.15	-	-	10,741,473.05	11,272,808.20
上年度末 2024 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	654,598.26	-	-	-	654,598.26
结算备付金	72,882.75	-	-	-	72,882.75
存出保证金	2,617.11	-	-	-	2,617.11
交易性金融资产	-	-	-	15,233,491.73	15,233,491.73
其他资产	-	-	-	880.00	880.00
资产总计	730,098.12	-	-	15,234,371.73	15,964,469.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,043.75	7,043.75
应付托管费	-	-	-	1,408.74	1,408.74
其他负债	-	-	-	27,890.01	27,890.01
负债总计	-	-	-	36,342.50	36,342.50
利率敏感度缺口	730,098.12	-	-	15,198,029.23	15,928,127.35

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

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 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		上年度末 2024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	10,712,924.24	95.03	15,233,491.73	95.64
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	10,712,924.24	95.03	15,233,491.73	95.64

##### 7.4.13.4.3.2 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	510,996.25	723,473.78
	业绩比较基准下降5%	-510,996.25	-723,473.78

#### 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	上年度末 2024年12月31日
第一层次	10,712,924.24	15,172,843.73
第二层次	-	60,648.00
第三层次	-	-
合计	10,712,924.24	15,233,491.73

###### 7.4.14.2.2 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。

#### 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

注：无。

##### 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

注：无。

#### 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 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	10,712,924.24	94.57
	其中：股票	10,712,924.24	94.57
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	529,798.09	4.68
8	其他各项资产	85,087.58	0.75

9	合计	11,327,809.91	100.00
---	----	---------------	--------

注：股票投资含可退替代款估值增值。

## 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	82,149.00	0.73
B	采矿业	652,475.00	5.79
C	制造业	6,089,814.10	54.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	268,071.00	2.38
E	建筑业	131,291.00	1.16
F	批发和零售业	88,120.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	240,421.00	2.13
H	住宿和餐饮业	40,432.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	508,937.96	4.51
J	金融业	1,556,464.10	13.81
K	房地产业	58,127.00	0.52
L	租赁和商务服务业	188,400.00	1.67
M	科学研究和技术服务业	103,857.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	1,354.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,294.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	73,154.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	10,086,361.16	89.48

### 8.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	428,939.08	3.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,832.00	0.40
E	建筑业	3,174.00	0.03

F	批发和零售业	35,038.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	5,025.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,691.00	0.51
J	金融业	12,337.00	0.11
K	房地产业	21,522.00	0.19
L	租赁和商务服务业	681.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,720.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,394.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	6,210.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	626,563.08	5.56

### 8.2.3 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。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	500	183,630.00	1.63
2	600519	贵州茅台	100	137,718.00	1.22
3	000725	京东方A	29,900	125,879.00	1.12
4	601318	中国平安	1,800	123,120.00	1.09
5	601899	紫金矿业	3,500	120,645.00	1.07
6	600919	江苏银行	9,200	95,680.00	0.85
7	002475	立讯精密	1,600	90,736.00	0.80
8	300502	新易盛	200	86,176.00	0.76
9	600219	南山铝业	15,600	83,928.00	0.74
10	000166	申万宏源	15,500	81,685.00	0.72
11	300136	信维通信	1,300	80,600.00	0.71
12	300115	长盈精密	1,700	79,050.00	0.70
13	601211	国泰海通	3,742	76,898.10	0.68
14	002027	分众传媒	10,300	75,911.00	0.67

15	000333	美的集团	900	70,335.00	0.62
16	000100	TCL 科技	15,000	68,100.00	0.60
17	600690	海尔智家	2,600	67,834.00	0.60
18	002414	高德红外	4,600	67,482.00	0.60
19	300857	协创数据	400	67,472.00	0.60
20	300017	网宿科技	6,400	65,600.00	0.58
21	600019	宝钢股份	8,800	65,560.00	0.58
22	300059	东方财富	2,800	64,904.00	0.58
23	689009	九号公司	1,138	63,261.42	0.56
24	600901	江苏金租	10,200	62,424.00	0.55
25	601077	渝农商行	9,600	62,016.00	0.55
26	000783	长江证券	7,400	60,310.00	0.54
27	600030	中信证券	2,100	60,291.00	0.53
28	300124	汇川技术	800	60,264.00	0.53
29	300058	蓝色光标	5,200	59,904.00	0.53
30	601600	中国铝业	4,900	59,878.00	0.53
31	600926	杭州银行	3,900	59,592.00	0.53
32	002185	华天科技	5,400	59,238.00	0.53
33	002594	比亚迪	600	58,632.00	0.52
34	000568	泸州老窖	500	58,110.00	0.52
35	600549	厦门钨业	1,400	57,484.00	0.51
36	600988	赤峰黄金	1,800	56,232.00	0.50
37	601328	交通银行	7,700	55,825.00	0.50
38	600141	兴发集团	1,600	55,328.00	0.49
39	600029	南方航空	6,900	55,269.00	0.49
40	601668	中国建筑	10,700	54,891.00	0.49
41	002432	九安医疗	1,300	52,052.00	0.46
42	600809	山西汾酒	300	51,510.00	0.46
43	600958	东方证券	4,700	51,230.00	0.45
44	000933	神火股份	1,800	49,446.00	0.44
45	002281	光迅科技	700	48,965.00	0.43
46	300308	中际旭创	80	48,800.00	0.43
47	688617	惠泰医疗	200	48,654.00	0.43
48	601166	兴业银行	2,300	48,438.00	0.43
49	300759	康龙化成	1,700	48,331.00	0.43
50	000997	新大陆	1,700	48,144.00	0.43
51	688981	中芯国际	391	48,026.53	0.43
52	605117	德业股份	556	47,927.20	0.43
53	603298	杭叉集团	1,800	47,826.00	0.42
54	002444	巨星科技	1,400	47,628.00	0.42
55	000426	兴业银锡	1,300	46,280.00	0.41
56	601216	君正集团	9,600	46,272.00	0.41
57	601928	凤凰传媒	4,600	46,184.00	0.41

58	601398	工商银行	5,800	45,994.00	0.41
59	603979	金诚信	600	45,690.00	0.41
60	603259	药明康德	500	45,320.00	0.40
61	601658	邮储银行	8,300	45,235.00	0.40
62	000792	盐湖股份	1,600	45,056.00	0.40
63	002851	麦格米特	500	45,035.00	0.40
64	000050	深天马 A	4,900	44,247.00	0.39
65	600900	长江电力	1,600	43,504.00	0.39
66	600598	北大荒	2,900	43,355.00	0.38
67	603986	兆易创新	200	42,850.00	0.38
68	600050	中国联通	8,300	42,413.00	0.38
69	688578	艾力斯	400	41,660.00	0.37
70	002203	海亮股份	3,200	40,512.00	0.36
71	601088	中国神华	1,000	40,500.00	0.36
72	600754	锦江酒店	1,600	40,432.00	0.36
73	688772	珠海冠宇	1,874	40,347.22	0.36
74	688002	睿创微纳	400	40,320.00	0.36
75	688778	厦钨新能	520	40,232.40	0.36
76	300972	万辰集团	200	40,214.00	0.36
77	600021	上海电力	2,000	40,040.00	0.36
78	601288	农业银行	5,200	39,936.00	0.35
79	600028	中国石化	6,400	39,552.00	0.35
80	688111	金山办公	128	39,304.96	0.35
81	600372	中航机载	2,900	38,918.00	0.35
82	688183	生益电子	400	38,276.00	0.34
83	688213	思特威	400	38,036.00	0.34
84	600426	华鲁恒升	1,200	37,716.00	0.33
85	600016	民生银行	9,700	37,151.00	0.33
86	600329	达仁堂	800	36,496.00	0.32
87	603379	三美股份	600	36,432.00	0.32
88	000651	格力电器	900	36,198.00	0.32
89	002773	康弘药业	1,200	35,964.00	0.32
90	600183	生益科技	500	35,705.00	0.32
91	601688	华泰证券	1,500	35,385.00	0.31
92	688099	晶晨股份	400	34,892.00	0.31
93	002461	珠江啤酒	3,700	34,373.00	0.30
94	000959	首钢股份	7,000	34,300.00	0.30
95	002064	华峰化学	3,100	34,100.00	0.30
96	688008	澜起科技	289	34,044.20	0.30
97	300207	欣旺达	1,300	33,995.00	0.30
98	002595	豪迈科技	400	33,804.00	0.30
99	688278	特宝生物	400	33,472.00	0.30
100	000960	锡业股份	1,200	33,456.00	0.30

101	600096	云天化	1,000	33,410.00	0.30
102	601168	西部矿业	1,200	33,168.00	0.29
103	601100	恒立液压	300	32,973.00	0.29
104	601816	京沪高铁	6,400	32,960.00	0.29
105	002273	水晶光电	1,300	32,656.00	0.29
106	001389	广合科技	400	32,652.00	0.29
107	002756	永兴材料	600	32,550.00	0.29
108	688819	天能股份	979	32,522.38	0.29
109	600487	亨通光电	1,300	32,149.00	0.29
110	000429	粤高速 A	2,700	31,806.00	0.28
111	300699	光威复材	800	31,568.00	0.28
112	600563	法拉电子	300	31,485.00	0.28
113	002831	裕同科技	1,100	31,361.00	0.28
114	000878	云南铜业	1,500	30,765.00	0.27
115	002312	川发龙蟒	2,800	30,604.00	0.27
116	300604	长川科技	300	30,393.00	0.27
117	600941	中国移动	300	30,315.00	0.27
118	000063	中兴通讯	800	30,272.00	0.27
119	300395	菲利华	300	30,090.00	0.27
120	300735	光弘科技	1,200	29,832.00	0.26
121	601699	潞安环能	2,500	29,500.00	0.26
122	601717	中创智领	1,200	29,460.00	0.26
123	601012	隆基绿能	1,600	29,120.00	0.26
124	603766	隆鑫通用	1,800	28,998.00	0.26
125	600177	雅戈尔	3,800	28,880.00	0.26
126	300476	胜宏科技	100	28,758.00	0.26
127	300724	捷佳伟创	300	28,680.00	0.25
128	002670	国盛证券	1,700	28,628.00	0.25
129	600884	杉杉股份	2,100	28,371.00	0.25
130	603338	浙江鼎力	500	28,320.00	0.25
131	603129	春风动力	100	27,868.00	0.25
132	600967	内蒙一机	1,600	26,880.00	0.24
133	000598	兴蓉环境	3,700	26,529.00	0.24
134	301498	乖宝宠物	400	26,060.00	0.23
135	603833	欧派家居	500	26,045.00	0.23
136	601857	中国石油	2,500	26,025.00	0.23
137	600862	中航高科	1,100	25,993.00	0.23
138	002340	格林美	3,100	25,916.00	0.23
138	601766	中国中车	3,800	25,916.00	0.23
139	601728	中国电信	4,100	25,830.00	0.23
140	300001	特锐德	1,000	25,680.00	0.23
141	601179	中国西电	2,800	25,480.00	0.23
142	000623	吉林敖东	1,300	25,389.00	0.23

143	601128	常熟银行	3,600	25,344.00	0.22
144	601567	三星医疗	1,100	25,322.00	0.22
145	002714	牧原股份	500	25,290.00	0.22
145	002938	鹏鼎控股	500	25,290.00	0.22
146	601019	山东出版	2,900	25,056.00	0.22
147	603737	三棵树	540	24,985.80	0.22
148	601001	晋控煤业	1,900	24,985.00	0.22
149	600166	福田汽车	8,500	24,820.00	0.22
149	601138	工业富联	400	24,820.00	0.22
150	600848	上海临港	2,100	24,570.00	0.22
151	300274	阳光电源	140	23,945.60	0.21
152	603345	安井食品	300	23,784.00	0.21
153	600295	鄂尔多斯	1,900	23,484.00	0.21
154	600578	京能电力	4,600	23,460.00	0.21
155	000887	中鼎股份	1,000	23,210.00	0.21
156	300454	深信服	200	23,032.00	0.20
157	688525	佰维存储	200	22,958.00	0.20
158	002202	金风科技	1,100	22,440.00	0.20
159	601818	光大银行	6,400	22,336.00	0.20
160	600282	南钢股份	4,200	22,092.00	0.20
161	600642	申能股份	2,800	21,784.00	0.19
162	002262	恩华药业	900	21,717.00	0.19
163	002558	巨人网络	500	21,645.00	0.19
164	688347	华虹公司	200	21,574.00	0.19
165	601988	中国银行	3,700	21,201.00	0.19
166	600938	中国海油	700	21,126.00	0.19
167	601390	中国中铁	3,900	21,099.00	0.19
168	300394	天孚通信	100	20,303.00	0.18
169	600887	伊利股份	700	20,020.00	0.18
170	688629	华丰科技	200	20,012.00	0.18
171	000977	浪潮信息	300	19,980.00	0.18
172	601058	赛轮轮胎	1,200	19,416.00	0.17
173	000893	亚钾国际	400	19,188.00	0.17
173	601225	陕西煤业	900	19,188.00	0.17
174	600415	小商品城	1,200	19,140.00	0.17
175	002683	广东宏大	400	19,120.00	0.17
176	300760	迈瑞医疗	100	19,045.00	0.17
177	600118	中国卫星	200	18,990.00	0.17
178	601888	中国中免	200	18,912.00	0.17
179	688375	国博电子	200	18,622.00	0.17
180	688266	泽璟制药	200	18,540.00	0.16
181	300408	三环集团	400	18,300.00	0.16
182	601919	中远海控	1,200	18,216.00	0.16

183	601628	中国人寿	400	18,200.00	0.16
184	600546	山煤国际	1,800	18,162.00	0.16
185	600795	国电电力	3,600	18,144.00	0.16
186	600998	九州通	3,500	17,920.00	0.16
187	600276	恒瑞医药	300	17,871.00	0.16
188	688041	海光信息	78	17,503.98	0.16
189	000559	万向钱潮	1,000	17,200.00	0.15
190	600031	三一重工	800	16,904.00	0.15
191	600808	马钢股份	4,000	16,880.00	0.15
192	002142	宁波银行	600	16,854.00	0.15
193	600999	招商证券	1,000	16,640.00	0.15
194	002261	拓维信息	500	16,550.00	0.15
195	002624	完美世界	1,000	16,390.00	0.15
196	300623	捷捷微电	600	16,302.00	0.14
197	688469	芯联集成	2,409	16,116.21	0.14
198	002371	北方华创	35	16,067.80	0.14
199	603993	洛阳钼业	800	16,000.00	0.14
200	600989	宝丰能源	800	15,704.00	0.14
201	002508	老板电器	800	15,480.00	0.14
202	000528	柳工	1,300	15,431.00	0.14
203	603816	顾家家居	500	15,370.00	0.14
204	600497	驰宏锌锗	2,100	15,351.00	0.14
205	600885	宏发股份	500	15,200.00	0.13
206	300433	蓝思科技	500	15,135.00	0.13
207	688122	西部超导	200	14,916.00	0.13
208	000001	平安银行	1,300	14,833.00	0.13
209	600637	东方明珠	1,500	14,775.00	0.13
210	000938	紫光股份	600	14,760.00	0.13
210	688281	华秦科技	200	14,760.00	0.13
211	688385	复旦微电	200	14,740.00	0.13
212	000975	山金国际	600	14,598.00	0.13
213	600970	中材国际	1,400	14,546.00	0.13
214	601615	明阳智能	1,000	14,480.00	0.13
215	603728	鸣志电器	200	14,470.00	0.13
216	000999	华润三九	500	14,230.00	0.13
217	002353	杰瑞股份	200	14,166.00	0.13
218	002493	荣盛石化	1,200	14,052.00	0.12
219	002423	中粮资本	1,200	14,040.00	0.12
220	300558	贝达药业	300	14,007.00	0.12
221	002128	电投能源	500	13,955.00	0.12
222	600039	四川路桥	1,400	13,930.00	0.12
223	601939	建设银行	1,500	13,920.00	0.12
224	601198	东兴证券	1,000	13,880.00	0.12

225	000338	潍柴动力	800	13,760.00	0.12
226	002065	东华软件	1,500	13,725.00	0.12
227	603087	甘李药业	200	13,614.00	0.12
228	300373	扬杰科技	200	13,600.00	0.12
229	600010	包钢股份	5,700	13,566.00	0.12
230	600909	华安证券	2,000	13,560.00	0.12
231	300498	温氏股份	800	13,504.00	0.12
232	601066	中信建投	500	13,385.00	0.12
233	601399	国机重装	2,800	13,384.00	0.12
234	000415	渤海租赁	3,300	13,365.00	0.12
235	600089	特变电工	600	13,332.00	0.12
236	688582	芯动联科	200	13,222.00	0.12
237	688223	晶科能源	2,344	13,220.16	0.12
238	601111	中国国航	1,400	13,118.00	0.12
239	300803	指南针	100	13,087.00	0.12
240	600066	宇通客车	400	13,080.00	0.12
241	000301	东方盛虹	1,200	13,068.00	0.12
242	001696	宗申动力	600	13,014.00	0.12
243	600660	福耀玻璃	200	12,954.00	0.11
244	301358	湖南裕能	200	12,932.00	0.11
245	600582	天地科技	2,200	12,826.00	0.11
246	600378	昊华科技	400	12,784.00	0.11
247	603341	龙旗科技	300	12,678.00	0.11
248	601000	唐山港	3,300	12,672.00	0.11
249	600517	国网英大	2,100	12,621.00	0.11
250	600363	联创光电	200	12,612.00	0.11
251	600115	中国东航	2,100	12,600.00	0.11
252	603501	豪威集团	100	12,590.00	0.11
253	601601	中国太保	300	12,573.00	0.11
254	601872	招商轮船	1,400	12,572.00	0.11
255	600863	华能蒙电	2,800	12,544.00	0.11
256	600499	科达制造	900	12,483.00	0.11
257	600208	衢州发展	3,200	12,384.00	0.11
258	601799	星宇股份	100	12,337.00	0.11
259	600126	杭钢股份	1,500	12,240.00	0.11
260	600095	湘财股份	1,100	12,166.00	0.11
261	002304	洋河股份	200	12,148.00	0.11
262	688538	和辉光电	4,552	12,108.32	0.11
263	688475	萤石网络	400	12,044.00	0.11
264	002920	德赛西威	100	12,030.00	0.11
265	002415	海康威视	400	11,936.00	0.11
266	688336	三生国健	200	11,914.00	0.11
267	601990	南京证券	1,500	11,880.00	0.11

268	000703	恒逸石化	1,100	11,847.00	0.11
269	000963	华东医药	300	11,835.00	0.10
270	300677	英科医疗	300	11,670.00	0.10
271	000155	川能动力	1,000	11,650.00	0.10
272	300570	太辰光	100	11,555.00	0.10
273	600160	巨化股份	300	11,526.00	0.10
274	600968	海油发展	3,000	11,520.00	0.10
275	600309	万华化学	150	11,502.00	0.10
276	002352	顺丰控股	300	11,496.00	0.10
277	002241	歌尔股份	400	11,492.00	0.10
278	688172	燕东微	397	11,489.18	0.10
279	002236	大华股份	600	11,364.00	0.10
280	600562	国睿科技	400	11,304.00	0.10
281	600406	国电南瑞	500	11,240.00	0.10
282	600760	中航沈飞	200	11,230.00	0.10
283	688009	中国通号	2,007	10,978.29	0.10
284	002195	岩山科技	1,500	10,635.00	0.09
285	600905	三峡能源	2,600	10,634.00	0.09
286	688472	阿特斯	713	10,630.83	0.09
287	000858	五粮液	100	10,594.00	0.09
288	688396	华润微	200	10,572.00	0.09
289	002155	湖南黄金	500	10,545.00	0.09
290	601995	中金公司	300	10,500.00	0.09
291	600018	上港集团	1,900	10,298.00	0.09
292	601009	南京银行	900	10,287.00	0.09
293	000539	粤电力A	2,300	10,166.00	0.09
294	000768	中航西飞	400	10,152.00	0.09
295	000060	中金岭南	1,700	9,945.00	0.09
296	000921	海信家电	400	9,924.00	0.09
297	000537	绿发电力	1,200	9,852.00	0.09
298	000423	东阿阿胶	200	9,816.00	0.09
299	300413	芒果超媒	400	9,768.00	0.09
300	002625	光启技术	200	9,752.00	0.09
301	601016	节能风电	3,300	9,735.00	0.09
302	600171	上海贝岭	300	9,375.00	0.08
303	002709	天赐材料	200	9,266.00	0.08
304	600061	国投资本	1,200	9,180.00	0.08
305	688126	沪硅产业	424	9,175.36	0.08
306	601868	中国能建	3,900	9,165.00	0.08
307	002459	晶澳科技	800	9,160.00	0.08
308	603296	华勤技术	100	9,074.00	0.08
309	000630	铜陵有色	1,500	9,015.00	0.08
310	000932	华菱钢铁	1,600	8,992.00	0.08

311	600015	华夏银行	1,300	8,931.00	0.08
312	603529	爱玛科技	300	8,910.00	0.08
313	601377	兴业证券	1,200	8,904.00	0.08
314	000009	中国宝安	900	8,865.00	0.08
315	600959	江苏有线	2,500	8,600.00	0.08
316	301611	珂玛科技	100	8,573.00	0.08
317	603019	中科曙光	100	8,564.00	0.08
318	603806	福斯特	600	8,376.00	0.07
319	601877	正泰电器	300	8,367.00	0.07
320	000425	徐工机械	700	8,106.00	0.07
321	000563	陕国投 A	2,300	7,935.00	0.07
322	300003	乐普医疗	500	7,905.00	0.07
323	300529	健帆生物	400	7,868.00	0.07
324	601360	三六零	700	7,819.00	0.07
325	603786	科博达	100	7,810.00	0.07
326	601006	大秦铁路	1,500	7,740.00	0.07
327	688387	信科移动	598	7,714.20	0.07
328	600435	北方导航	500	7,710.00	0.07
329	000709	河钢股份	3,300	7,623.00	0.07
330	000728	国元证券	900	7,515.00	0.07
331	601825	沪农商行	800	7,432.00	0.07
332	002409	雅克科技	100	7,410.00	0.07
333	600048	保利发展	1,200	7,320.00	0.06
334	002463	沪电股份	100	7,307.00	0.06
335	601319	中国人保	800	7,160.00	0.06
336	601698	中国卫通	200	7,146.00	0.06
337	300628	亿联网络	200	7,130.00	0.06
338	601456	国联民生	700	7,119.00	0.06
339	601336	新华保险	100	6,970.00	0.06
340	001979	招商蛇口	800	6,912.00	0.06
341	601186	中国铁建	900	6,903.00	0.06
342	300661	圣邦股份	100	6,864.00	0.06
343	603799	华友钴业	100	6,826.00	0.06
344	600011	华能国际	900	6,714.00	0.06
345	600339	中油工程	2,000	6,700.00	0.06
346	000776	广发证券	300	6,606.00	0.06
347	601169	北京银行	1,200	6,576.00	0.06
348	601878	浙商证券	600	6,486.00	0.06
349	688599	天合光能	384	6,355.20	0.06
350	601958	金铂股份	400	6,232.00	0.06
351	601898	中煤能源	500	6,220.00	0.06
352	002600	领益智造	400	6,216.00	0.06
353	601298	青岛港	700	5,838.00	0.05

354	300073	当升科技	100	5,780.00	0.05
355	300347	泰格医药	100	5,670.00	0.05
356	300832	新产业	100	5,625.00	0.05
357	002311	海大集团	100	5,538.00	0.05
358	002050	三花智控	100	5,531.00	0.05
359	600362	江西铜业	100	5,492.00	0.05
360	600522	中天科技	300	5,436.00	0.05
361	300442	润泽科技	100	5,280.00	0.05
362	002736	国信证券	400	5,248.00	0.05
362	600886	国投电力	400	5,248.00	0.05
363	601991	大唐发电	1,500	5,235.00	0.05
364	002252	上海莱士	800	5,072.00	0.04
365	000898	鞍钢股份	2,000	5,060.00	0.04
366	000021	深科技	200	5,056.00	0.04
367	000830	鲁西化工	300	4,971.00	0.04
368	600233	圆通速递	300	4,926.00	0.04
369	000062	深圳华强	200	4,924.00	0.04
370	600801	华新建材	200	4,908.00	0.04
371	301236	软通动力	100	4,743.00	0.04
372	600489	中金黄金	200	4,672.00	0.04
373	000750	国海证券	1,100	4,664.00	0.04
374	600380	健康元	400	4,620.00	0.04
375	600918	中泰证券	700	4,550.00	0.04
376	300676	华大基因	100	4,536.00	0.04
377	601117	中国化学	600	4,518.00	0.04
378	600346	恒力石化	200	4,506.00	0.04
379	000729	燕京啤酒	400	4,492.00	0.04
380	002517	恺英网络	200	4,374.00	0.04
381	603939	益丰药房	200	4,344.00	0.04
382	601808	中海油服	300	4,212.00	0.04
383	601669	中国电建	800	4,160.00	0.04
384	600873	梅花生物	400	4,052.00	0.04
385	601918	新集能源	600	3,966.00	0.04
386	600007	中国国贸	200	3,964.00	0.04
387	002841	视源股份	100	3,963.00	0.04
388	002601	龙佰集团	200	3,916.00	0.03
389	002074	国轩高科	100	3,911.00	0.03
390	600547	山东黄金	100	3,871.00	0.03
391	600602	云赛智联	200	3,738.00	0.03
392	000683	博源化工	500	3,720.00	0.03
393	002429	兆驰股份	500	3,710.00	0.03
394	600584	长电科技	100	3,678.00	0.03
395	300316	晶盛机电	100	3,675.00	0.03

396	601916	浙商银行	1,200	3,648.00	0.03
397	002179	中航光电	100	3,544.00	0.03
398	601233	桐昆股份	200	3,442.00	0.03
399	688100	威胜信息	86	3,379.80	0.03
400	600739	辽宁成大	300	3,354.00	0.03
401	300015	爱尔眼科	300	3,294.00	0.03
402	000807	云铝股份	100	3,284.00	0.03
403	600009	上海机场	100	3,276.00	0.03
404	600098	广州发展	500	3,270.00	0.03
405	002532	天山铝业	200	3,236.00	0.03
406	601838	成都银行	200	3,224.00	0.03
407	601865	福莱特	200	3,134.00	0.03
408	002007	华兰生物	200	3,026.00	0.03
409	001965	招商公路	300	3,024.00	0.03
410	603899	晨光股份	100	2,706.00	0.02
411	000895	双汇发展	100	2,647.00	0.02
412	600188	兖矿能源	200	2,630.00	0.02
413	000157	中联重科	300	2,589.00	0.02
414	002001	新和成	100	2,519.00	0.02
415	000786	北新建材	100	2,497.00	0.02
416	600704	物产中大	400	2,228.00	0.02
417	600032	浙江新能	300	2,223.00	0.02
418	002608	江苏国信	300	2,217.00	0.02
419	000629	钒钛股份	700	2,170.00	0.02
420	000937	冀中能源	400	2,152.00	0.02
421	002436	兴森科技	100	2,117.00	0.02
422	601618	中国中冶	700	2,079.00	0.02
423	600845	宝信软件	100	2,071.00	0.02
424	600027	华电国际	400	1,984.00	0.02
425	688187	时代电气	38	1,949.02	0.02
426	603225	新凤鸣	100	1,946.00	0.02
427	000983	山西焦煤	300	1,926.00	0.02
428	600109	国金证券	200	1,860.00	0.02
429	600062	华润双鹤	100	1,829.00	0.02
430	603077	和邦生物	800	1,808.00	0.02
431	000591	太阳能	400	1,776.00	0.02
432	603233	大参林	100	1,762.00	0.02
433	601108	财通证券	200	1,744.00	0.02
434	600871	石化油服	800	1,728.00	0.02
435	600176	中国巨石	100	1,710.00	0.02
436	000951	中国重汽	100	1,690.00	0.01
437	002299	圣农发展	100	1,654.00	0.01
438	000987	越秀资本	200	1,628.00	0.01

439	000739	普洛药业	100	1,627.00	0.01
440	600131	国网信通	100	1,614.00	0.01
441	600663	陆家嘴	200	1,582.00	0.01
442	002078	太阳纸业	100	1,575.00	0.01
443	002958	青农商行	500	1,550.00	0.01
444	600655	豫园股份	300	1,539.00	0.01
445	600535	天士力	100	1,507.00	0.01
446	601966	玲珑轮胎	100	1,453.00	0.01
447	601018	宁波港	400	1,452.00	0.01
448	601155	新城控股	100	1,395.00	0.01
449	002152	广电运通	100	1,381.00	0.01
450	000883	湖北能源	300	1,362.00	0.01
451	300140	节能环保	200	1,354.00	0.01
452	002410	广联达	100	1,258.00	0.01
453	600000	浦发银行	100	1,244.00	0.01
454	601333	广深铁路	400	1,216.00	0.01
455	300146	汤臣倍健	100	1,201.00	0.01
456	000785	居然智家	400	1,168.00	0.01
457	002739	万达电影	100	1,132.00	0.01
458	600688	上海石化	400	1,112.00	0.01
459	600390	五矿资本	200	1,110.00	0.01
460	002939	长城证券	100	1,020.00	0.01
461	601229	上海银行	100	1,010.00	0.01
462	000039	中集集团	100	1,009.00	0.01
463	603565	中谷物流	100	1,004.00	0.01
464	000825	太钢不锈	200	978.00	0.01
465	601577	长沙银行	100	970.00	0.01
466	000582	北部湾港	100	938.00	0.01
467	603707	健友股份	100	903.00	0.01
468	600348	华阳股份	100	826.00	0.01
469	601921	浙版传媒	100	782.00	0.01
470	600906	财达证券	100	667.00	0.01
471	600398	海澜之家	100	605.00	0.01
472	002500	山西证券	100	599.00	0.01
473	600583	海油工程	100	549.00	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	688068	热景生物	200	32,400.00	0.29
2	688037	芯源微	200	29,702.00	0.26
3	688088	虹软科技	592	29,304.00	0.26
4	603556	海兴电力	800	29,120.00	0.26
5	688630	芯碁微装	200	26,906.00	0.24

6	600867	通化东宝	2,900	23,693.00	0.21
7	601636	旗滨集团	3,900	23,127.00	0.21
8	688333	铂力特	200	22,302.00	0.20
9	600325	华发股份	5,100	21,522.00	0.19
10	688776	国光电气	200	20,148.00	0.18
11	300443	金雷股份	700	19,691.00	0.17
12	688153	唯捷创芯	522	19,648.08	0.17
13	300229	拓尔思	900	17,910.00	0.16
14	000543	皖能电力	2,200	17,490.00	0.16
15	603308	应流股份	400	16,700.00	0.15
16	603997	继峰股份	1,100	15,290.00	0.14
17	688209	英集芯	600	11,964.00	0.11
18	301606	绿联科技	200	11,748.00	0.10
19	600155	华创云信	1,700	11,254.00	0.10
20	301376	致欧科技	600	10,842.00	0.10
21	002091	江苏国泰	1,200	10,836.00	0.10
22	002215	诺普信	1,000	10,590.00	0.09
23	002911	佛燃能源	800	9,696.00	0.09
24	603202	天有为	100	9,181.00	0.08
25	601778	晶科科技	2,100	7,812.00	0.07
26	002043	兔宝宝	500	7,205.00	0.06
27	688612	威迈斯	200	6,594.00	0.06
28	605599	菜百股份	400	6,548.00	0.06
29	300236	上海新阳	100	6,376.00	0.06
30	002612	朗姿股份	300	6,132.00	0.05
31	002396	星网锐捷	200	6,060.00	0.05
32	002100	天康生物	800	5,896.00	0.05
33	600323	瀚蓝环境	200	5,720.00	0.05
34	002317	众生药业	300	5,694.00	0.05
35	601208	东材科技	200	5,418.00	0.05
36	301267	华夏眼科	300	5,394.00	0.05
37	600729	重庆百货	200	5,200.00	0.05
38	000600	建投能源	600	5,118.00	0.05
39	600258	首旅酒店	300	5,025.00	0.04
40	301363	美好医疗	200	4,810.00	0.04
41	002389	航天彩虹	200	4,796.00	0.04
42	688351	微电生理	200	4,630.00	0.04
43	301087	可孚医疗	100	4,467.00	0.04
44	003006	百亚股份	200	4,368.00	0.04
45	300770	新媒股份	100	4,241.00	0.04
46	603530	神马电力	100	4,108.00	0.04
47	002345	潮宏基	300	3,750.00	0.03
48	600507	方大特钢	600	3,534.00	0.03

49	000719	中原传媒	300	3,528.00	0.03
50	601003	柳钢股份	700	3,521.00	0.03
51	002110	三钢闽光	800	3,512.00	0.03
52	300451	创业慧康	700	3,388.00	0.03
53	601068	中铝国际	600	3,174.00	0.03
54	300773	拉卡拉	100	2,848.00	0.03
55	600461	洪城环境	300	2,781.00	0.02
56	600782	新钢股份	700	2,716.00	0.02
57	601900	南方传媒	200	2,682.00	0.02
58	000672	上峰水泥	200	2,598.00	0.02
59	603733	仙鹤股份	100	2,417.00	0.02
60	000030	富奥股份	400	2,296.00	0.02
61	000791	甘肃能源	300	1,935.00	0.02
62	600963	岳阳林纸	400	1,868.00	0.02
63	002237	恒邦股份	100	1,342.00	0.01
64	002507	涪陵榨菜	100	1,291.00	0.01
65	601963	重庆银行	100	1,083.00	0.01
66	600710	苏美达	100	1,081.00	0.01
67	600210	紫江企业	100	735.00	0.01
68	600185	珠免集团	100	681.00	0.01
69	002701	奥瑞金	100	595.00	0.01
70	002251	步步高	100	531.00	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	601328	交通银行	343,962.00	2.16
2	601211	国泰海通	332,261.96	2.09
3	688111	金山办公	314,508.04	1.97
4	600519	贵州茅台	299,431.00	1.88
5	002475	立讯精密	292,173.00	1.83
6	300750	宁德时代	279,719.00	1.76
7	300308	中际旭创	265,256.00	1.67
8	600919	江苏银行	258,853.00	1.63
9	601899	紫金矿业	256,989.00	1.61
10	601398	工商银行	256,117.00	1.61
11	601318	中国平安	253,960.00	1.59
12	603259	药明康德	252,789.00	1.59
13	688041	海光信息	230,679.88	1.45
14	000333	美的集团	227,298.00	1.43
15	600030	中信证券	226,003.00	1.42
16	688981	中芯国际	220,272.08	1.38
17	601166	兴业银行	219,996.00	1.38

18	002594	比亚迪	217,354.00	1.36
19	601138	工业富联	216,627.00	1.36
20	600690	海尔智家	214,557.00	1.35

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。

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	580,327.00	3.64
2	601318	中国平安	511,723.00	3.21
3	601398	工商银行	469,373.00	2.95
4	300750	宁德时代	432,415.40	2.71
5	601899	紫金矿业	379,683.00	2.38
6	601211	国泰海通	369,235.00	2.32
7	601328	交通银行	356,066.00	2.24
8	601138	工业富联	345,847.00	2.17
9	603259	药明康德	317,110.00	1.99
10	600219	南山铝业	314,051.00	1.97
11	300308	中际旭创	312,667.00	1.96
12	600406	国电南瑞	306,302.00	1.92
13	600887	伊利股份	303,042.00	1.90
14	600276	恒瑞医药	299,613.00	1.88
15	601288	农业银行	284,362.00	1.79
16	688256	寒武纪	283,212.00	1.78
17	688111	金山办公	268,643.54	1.69
18	688041	海光信息	261,595.26	1.64
19	601816	京沪高铁	255,783.00	1.61
20	600050	中国联通	249,795.00	1.57

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。

#### 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	56,764,355.00
卖出股票收入（成交）总额	61,357,123.29

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。

#### 8.5 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。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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**

注：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**

注：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**

注：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**

本基金在本报告期末投资股指期货。

**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**

本基金在本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金在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。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

**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	1,537.06
2	应收清算款	81,840.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,710.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,087.58

**8.12.4 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。

### 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

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。

#### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名的股票不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 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。

## §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

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 (%)
177	49,393.36	7,092,723.00	81.13	1,649,901.00	18.87

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	东方证券股份有限公司	3,880,607.00	44.39
2	招商证券股份有限公司	2,125,490.00	24.31
3	广发证券股份有限公司	1,065,226.00	12.18
4	金雪雁	944,073.00	10.80
5	贾慧星	200,700.00	2.30
6	王专	44,000.00	0.50
7	刘玲剑	40,077.00	0.46
8	赖意珠	30,000.00	0.34
8	徐映雪	30,000.00	0.34
10	严金波	29,000.00	0.33

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额

总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 8 月 23 日） 基金份额总额	245,742,624.00
本报告期期初基金份额总额	14,742,624.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,742,624.00

## § 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，无基金份额持有人大会决议。

### 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，徐波先生自 2025 年 4 月 24 日起担任本基金管理人副总经理职务。

#### 11.2.2 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。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是容诚会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 0.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 2 年的审计服务。

### 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

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.2 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。

### 11.6.3 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。

### 11.6.4 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。

## 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 (%)	
华泰证券	6	52,704,911.08	44.66	7,691.02	44.66	-
开源证券	4	51,070,401.50	43.27	7,452.73	43.27	-
中信建投	2	9,943,597.38	8.43	1,450.72	8.42	撤销2个交易单元
西南证券	4	4,300,338.59	3.64	627.55	3.64	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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。

### 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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 1 月 15 日
2	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 1 月 16 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 1 月 17 日
4	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025 年 1 月 21 日
5	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 1 月 21 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于增加东北证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2025 年 2 月 11 日
7	《关于银华中证 800 增强策略交易型	本基金管理人网站, 中	2025 年 3 月 20 日

	开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告》	中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	
8	《关于召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 3 月 21 日
9	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 28 日
10	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 3 月 28 日
11	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 4 月 11 日
12	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 21 日
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 4 月 21 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2025 年 6 月 16 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于终止方正证券股份有限公司为旗下部分基金流动性服务商的公告》	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	2025 年 6 月 23 日
16	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 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	2025 年 7 月 18 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 7 月 18 日
18	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2025 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 1 日
19	《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产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 1 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于增加西部证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2025 年 8 月 18 日
21	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 29 日

22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 8 月 29 日
23	《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产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 25 日
24	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 10 月 25 日
25	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2025 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 25 日
26	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 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	2025 年 10 月 27 日
27	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 10 月 27 日
28	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2025 年 12 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250325-20250406	1,444,002.00	20,285,901.00	17,849,296.00	3,880,607.00	44.39
	1	20250508-20250508	1,444,002.00	20,285,901.00	17,849,296.00	3,880,607.00	44.39
	1	20250514-20251231	1,444,002.00	20,285,901.00	17,849,296.00	3,880,607.00	44.39
	2	20250416-20250505	1,357,026.00	20,454,200.00	20,746,000.00	1,065,226.00	12.18
	3	20250821-20250902	0.00	9,558,100.00	9,558,100.00	0.00	0.00
	4	20250101-20250914	4,311,888.00	24,578,455.00	26,764,853.00	2,125,490.00	24.31
	4	20250917-20	4,311,888.00	24,578,455.00	26,764,853.00	2,125,490.00	24.31

		251012	8.00	55.00	53.00	90.00	
4		20251014-20	4,311,88	24,578,4	26,764,8	2,125,4	24.31
		251231	8.00	55.00	53.00	90.00	
5		20250716-20	1,288,00	6,034,00	7,322,00		0.00
		250716	0.00	0.00	0.00	0.00	

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《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合同》

13.1.4 《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 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。

### 13.3 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2026年3月28日