

银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数
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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60

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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	2000 增强 ETF
场内简称	中证 2000 增强 ETF 银华
基金主代码	159555
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	34,462,705.00 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 12 月 12 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	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。 （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。 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。
业绩比较基准	中证 2000 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	杨军智
	联系电话	(010) 58163000	010-60834299
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	010-60836588
传真		(010) 58163027	010-60834004
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		100738	100125
法定代表人		王珠林	张佑君

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	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)
本期已实现收益	10,803,986.20
本期利润	7,375,030.65
加权平均基金份额本期利润	0.1935
本期加权平均净值利润率	10.87%
本期基金份额净值增长率	10.18%
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	27,965,637.83
期末可供分配基金份额利润	0.8115
期末基金资产净值	62,428,342.83
期末基金份额净值	1.8115
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	81.15%

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。

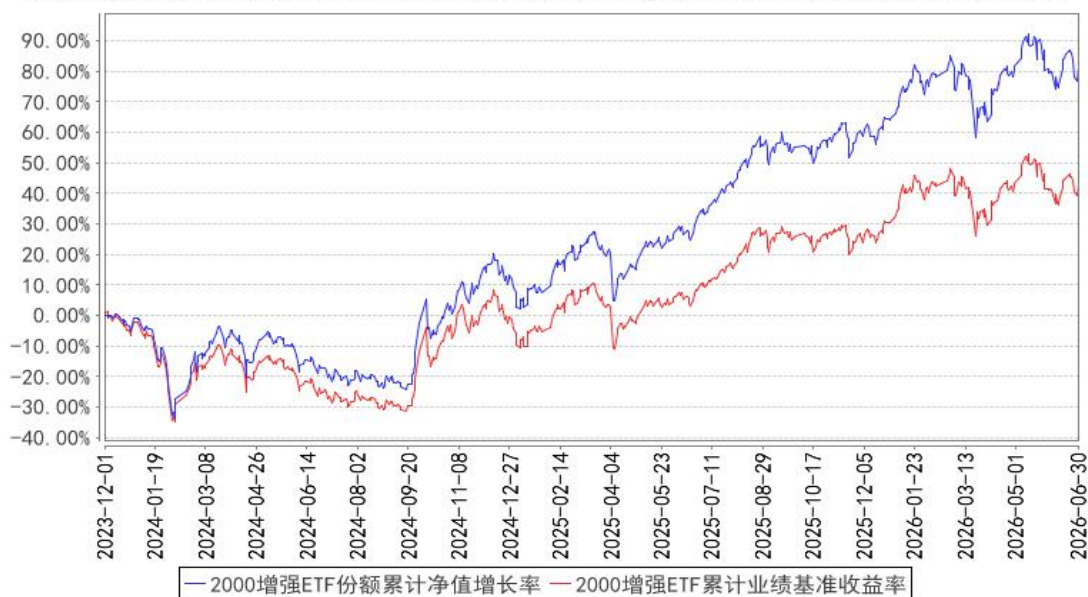
3.2 基金净值表现

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	9.24%	1.66%	7.78%	1.62%	1.46%	0.04%
过去六个月	10.18%	1.66%	9.10%	1.68%	1.08%	-0.02%
过去一年	35.02%	1.38%	29.14%	1.42%	5.88%	-0.04%
自基金合同生效起至今	81.15%	1.96%	42.42%	1.96%	38.73%	0.00%

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

2000增强ETF份额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



§ 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		
张凯先生	本基金的基金经理	2023 年 12 月 1 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。
张亦驰 先生	本基金的 基金经理	2023 年 12 月 1 日	-	11 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 5 月 25 日至 2023 年 9 月 27 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、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 5 月 25 日至 2024 年 8 月 28 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 2021 年 5 月 25 日至 2024 年 4 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发起式联接基金基金经理，自 2021 年 11 月 23 日至 2026 年 7 月 15 日兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、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 2022 年 6 月 20 日至 2023 年 9 月 27 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 2022 年 11 月 21 日起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 11 月 21 日至 2024 年 7 月 16 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 2022 年 11 月 21 日至 2023 年 12 月 19 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 2023 年 4 月 7 日至 2024 年 7 月 16 日兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日起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 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 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 2023 年 12 月 4 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 12 月 20 日至 2025 年 12 月 10 日兼任银华创业板中盘

					200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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 4 月 25 日起兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 6 日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 23 日起兼任银华中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 12 月 3 日起兼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 2025 年 9 月 17 日起兼任银华中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 11 日起兼任银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2026 年 6 月 18 日起兼任银华上证科创板芯片设计主题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 2000 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

2026年上半年,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。

在报告期内,我们运用自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

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1.8115元;本报告期基金份额净值增长率为10.18%,业绩比较基准收益率为9.10%。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，成为国民经济的主要支柱。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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，

完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由银华基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,240,772.95	1,628,886.88
结算备付金		472,355.64	281,399.37
存出保证金		69,764.57	91,443.90
交易性金融资产	6.4.7.2	61,262,291.17	69,890,029.46
其中：股票投资		61,262,291.17	69,890,029.46
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		-	62,894.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		63,045,184.33	71,954,653.61
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		403,807.70	352,304.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,891.45	29,706.58
应付托管费		5,378.29	5,941.30
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	6.4.7.9	180,764.06	110,101.95
负债合计		616,841.50	498,054.21
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	34,462,705.00	43,462,705.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,965,637.83	27,993,894.40
净资产合计		62,428,342.83	71,456,599.40
负债和净资产总计		63,045,184.33	71,954,653.61

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8115 元，基金份额总额 34,462,705.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,673,277.78	12,877,722.59
1. 利息收入		2,981.02	3,253.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,981.02	3,253.13
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）		11,135,698.11	7,555,573.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,877,492.80	7,239,030.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	258,205.31	316,542.60
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	-3,428,955.55	5,229,804.66
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	-36,445.80	89,091.27
减：二、营业总支出		298,247.13	283,658.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	167,955.84	130,672.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,591.16	26,134.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	96,700.13	126,852.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,375,030.65	12,594,063.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,375,030.65	12,594,063.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		7,375,030.65	12,594,063.89
----------	--	--------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	43,462,705.00	-	27,993,894.40	71,456,599.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	43,462,705.00	-	27,993,894.40	71,456,599.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,000,000.00	-	-28,256.57	-9,028,256.57
（一）、综合收益总额	-	-	7,375,030.65	7,375,030.65
（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）	-9,000,000.00	-	-7,403,287.22	-16,403,287.22
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-	8,587,564.16	20,587,564.16
2. 基金赎回款	-21,000,000.00	-	-15,990,851.38	-36,990,851.38
（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	34,462,705.00	-	27,965,637.83	62,428,342.83
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	55,462,705.00	-	5,129,578.71	60,592,283.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	55,462,705.00	-	5,129,578.71	60,592,283.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,000,000.00	-	6,647,025.20	-14,352,974.80
（一）、综合收益总额	-	-	12,594,063.89	12,594,063.89
（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）	-21,000,000.00	-	-5,947,038.69	-26,947,038.69
其中：1. 基金申购款	9,000,000.00	-	425,880.12	9,425,880.12
2. 基金赎回款	-30,000,000.00	-	-6,372,918.81	-36,372,918.81
（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	34,462,705.00	-	11,776,603.91	46,239,308.91

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 2000 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]2223 号《关于准予银华中证 2000 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 2000 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 223,454,000.00 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 0592 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2023 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,462,705.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 8,705.00 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,基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]1111 号核准,本基金 223,462,705.00 份基金份额于 2023 年 12 月 12 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 2000 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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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。本基金的业绩比较基准为：中证 2000 指数收益率。

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 2000 增强策略交易型开放式指数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[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[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 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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	1,240,772.95
等于：本金	1,240,653.51
加：应计利息	119.44
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	1,240,772.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	63,369,747.57	—	61,262,291.17	-2,107,456.40
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	63,369,747.57	—	61,262,291.17	-2,107,456.40

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。

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 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	64,064.81
其中：交易所市场	64,064.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	116,699.25
合计	180,764.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,462,705.00	43,462,705.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
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	34,462,705.00	34,462,705.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,515,170.26	-5,521,275.86	27,993,894.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	33,515,170.26	-5,521,275.86	27,993,894.40
本期利润	10,803,986.20	-3,428,955.55	7,375,030.65
本期基金份额交易产生的变动数	-8,146,925.99	743,638.77	-7,403,287.22
其中：基金申购款	10,912,963.15	-2,325,398.99	8,587,564.16
基金赎回款	-19,059,889.14	3,069,037.76	-15,990,851.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,172,230.47	-8,206,592.64	27,965,637.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,085.46
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	737.41
其他	158.15
合计	2,981.02

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 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	10,504,350.02
股票投资收益——赎回差价收入	373,142.78
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	10,877,492.80

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	368,782,210.95
减：卖出股票成本总额	357,939,830.73
减：交易费用	338,030.20
买卖股票差价收入	10,504,350.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	36,990,851.38
减：现金支付赎回款总额	14,969,069.38
减：赎回股票成本总额	21,648,639.22
减：交易费用	—
赎回差价收入	373,142.78

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	258,205.31
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	258,205.31

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,428,955.55
股票投资	-3,428,955.55
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	-3,428,955.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	-36,445.80
合计	-36,445.80

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	2,479.70

信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	—
其他	69,425.24
合计	96,700.13

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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信证券	731,343,709.16	100.00	495,680,244.13	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券	106,415.18	100.00	64,064.81	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券	72,349.84	100.00	31,283.21	100.00

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	167,955.84	130,672.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	39,569.55	20,764.19
应支付基金管理人的净管理费	128,386.29	109,908.01

注：本基金管理费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：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,591.16	26,134.47

注：支付基金托管人中信证券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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
银华长安资本 管理（北京） 有限公司	10,430,000.00	30.26	17,800,000.00	40.95
中信证券	1,452,439.00	4.21	1,449,101.00	3.33

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券	1,240,772.95	2,085.46	1,460,605.58	2,516.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管，存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

注：无。

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
603722	阿科力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	39.60	2026 年 7 月 6 日	43.56	900	35,225.89	35,640.00	-
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	2,300	11,295.38	9,890.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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同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 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	1,240,772.95	-	-	-	1,240,772.95
结算备付金	472,355.64	-	-	-	472,355.64
存出保证金	69,764.57	-	-	-	69,764.57
交易性金融资产	-	-	-	61,262,291.17	61,262,291.17
资产总计	1,782,893.16	-	-	61,262,291.17	63,045,184.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	26,891.45	26,891.45
应付托管费	-	-	-	5,378.29	5,378.29
应付清算款	-	-	-	403,807.70	403,807.70
其他负债	-	-	-	180,764.06	180,764.06
负债总计	-	-	-	616,841.50	616,841.50
利率敏感度缺口	1,782,893.16	-	-	60,645,449.67	62,428,342.83

上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,628,886.88	-	-	-	1,628,886.88
结算备付金	281,399.37	-	-	-	281,399.37
存出保证金	91,443.90	-	-	-	91,443.90
交易性金融资产	-	-	-	69,890,029.46	69,890,029.46
应收清算款	-	-	-	62,894.00	62,894.00
资产总计	2,001,730.15	-	-	69,952,923.46	71,954,653.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	29,706.58	29,706.58
应付托管费	-	-	-	5,941.30	5,941.30
应付清算款	-	-	-	352,304.38	352,304.38
其他负债	-	-	-	110,101.95	110,101.95
负债总计	-	-	-	498,054.21	498,054.21
利率敏感度缺口	2,001,730.15	-	-	69,454,869.25	71,456,599.40

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	61,262,291.17	98.13	69,890,029.46	97.81
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	61,262,291.17	98.13	69,890,029.46	97.81

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%	2,970,586.62	3,390,215.61
	业绩比较基准下降 5%	-2,970,586.62	-3,390,215.61

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	61,216,761.17	69,890,029.46
第二层次	45,530.00	—
第三层次	—	—
合计	61,262,291.17	69,890,029.46

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	61,262,291.17	97.17
	其中：股票	61,262,291.17	97.17
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	1,713,128.59	2.72
8	其他各项资产	69,764.57	0.11
9	合计	63,045,184.33	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

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	452,832.00	0.73
B	采矿业	765,278.00	1.23
C	制造业	41,552,167.02	66.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	637,254.00	1.02
E	建筑业	355,404.00	0.57
F	批发和零售业	1,478,221.00	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	768,119.00	1.23
H	住宿和餐饮业	100,611.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,948,773.57	7.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	421,463.00	0.68
L	租赁和商务服务业	960,399.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	712,676.06	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	806,147.07	1.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	309,161.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	546,813.00	0.88
S	综合	174,590.00	0.28

	合计	54,989,908.72	88.08
--	----	---------------	-------

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	65,040.00	0.10
B	采矿业	94,277.00	0.15
C	制造业	4,936,532.54	7.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,477.00	0.02
E	建筑业	82,964.00	0.13
F	批发和零售业	60,852.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	26,355.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	466,254.69	0.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	47,207.00	0.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	242,568.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	136,860.22	0.22
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	98,995.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	6,272,382.45	10.05

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	300490	华自科技	30,200	399,546.00	0.64
2	603538	美诺华	12,000	390,600.00	0.63
3	301529	福赛科技	3,580	344,968.80	0.55
4	300903	科翔股份	3,400	344,454.00	0.55
5	603239	浙江仙通	23,100	342,111.00	0.55

6	002969	嘉美包装	23,800	335,104.00	0.54
7	603626	科森科技	18,000	333,000.00	0.53
8	300201	海伦哲	14,900	313,943.00	0.50
9	300905	宝丽迪	6,200	313,720.00	0.50
10	688679	通源环境	7,223	304,016.07	0.49
11	300055	万邦达	44,600	286,778.00	0.46
12	605222	起帆电缆	12,100	282,172.00	0.45
13	300843	胜蓝股份	1,800	281,250.00	0.45
14	688098	申联生物	32,270	277,199.30	0.44
15	300143	盈康生命	40,900	275,666.00	0.44
16	002649	博彦科技	33,300	271,062.00	0.43
17	300587	天铁科技	70,000	269,500.00	0.43
18	688653	康希通信	15,435	268,260.30	0.43
19	688620	安凯微	16,239	263,071.80	0.42
20	301086	鸿富瀚	1,200	251,136.00	0.40
21	300129	泰胜风能	28,600	244,530.00	0.39
22	688226	威腾电气	5,695	243,916.85	0.39
23	688257	新锐股份	2,385	243,031.50	0.39
24	300164	通源石油	30,000	240,000.00	0.38
25	688758	赛分科技	10,796	237,619.96	0.38
26	001376	百通能源	22,700	236,080.00	0.38
27	301603	乔锋智能	1,600	230,080.00	0.37
28	300139	晓程科技	6,100	222,955.00	0.36
29	688191	智洋创新	6,192	221,054.40	0.35
30	688518	联赢激光	6,983	215,774.70	0.35
31	002455	百川股份	29,600	213,120.00	0.34
32	688648	中邮科技	5,795	211,807.25	0.34
33	600714	金瑞矿业	10,200	209,406.00	0.34
34	688267	中触媒	10,622	209,253.40	0.34
35	688125	安达智能	1,260	206,010.00	0.33
36	002042	华孚时尚	60,100	204,941.00	0.33
37	002885	京泉华	5,000	204,300.00	0.33
38	688225	亚信安全	16,283	202,234.86	0.32
39	002284	亚太股份	21,300	202,137.00	0.32
40	605286	同力天启	7,900	201,371.00	0.32
41	603286	日盈电子	4,400	200,772.00	0.32
42	600230	沧州大化	15,400	200,508.00	0.32
43	688173	希荻微	10,435	199,725.90	0.32
44	301285	鸿日达	1,800	198,594.00	0.32
45	300365	恒华科技	42,900	196,482.00	0.31
46	688553	汇宇制药	18,417	195,772.71	0.31
47	300426	华智数媒	38,600	195,316.00	0.31
48	688186	广大特材	12,646	191,586.90	0.31

49	688085	三友医疗	15,944	190,849.68	0.31
50	688697	纽威数控	13,997	190,219.23	0.30
51	688089	ST 嘉必优	17,905	189,972.05	0.30
52	002454	松芝股份	39,620	189,383.60	0.30
53	688510	航亚科技	7,920	189,129.60	0.30
54	688311	盟升电子	7,197	188,489.43	0.30
55	688308	欧科亿	1,036	188,355.16	0.30
56	600592	龙溪股份	13,300	188,328.00	0.30
57	300740	水羊股份	10,200	187,782.00	0.30
58	603703	盛洋科技	16,900	187,590.00	0.30
59	603660	苏州科达	15,200	186,200.00	0.30
60	600828	茂业商业	52,000	186,160.00	0.30
61	300980	祥源新材	6,300	185,283.00	0.30
62	600501	航天晨光	11,700	184,041.00	0.29
63	603115	海星股份	1,500	183,705.00	0.29
64	603168	莎普爱思	38,800	183,136.00	0.29
65	300191	潜能恒信	6,600	182,490.00	0.29
66	002348	高乐股份	17,300	182,342.00	0.29
67	002757	南兴股份	10,100	182,305.00	0.29
68	688588	凌志软件	19,930	181,163.70	0.29
69	688196	卓越新能	5,033	180,684.70	0.29
70	000735	罗 牛 山	38,000	180,500.00	0.29
71	603988	中电电机	11,100	180,042.00	0.29
72	603686	福龙马	13,900	179,588.00	0.29
73	300004	南风股份	17,700	178,770.00	0.29
74	600590	泰豪科技	17,600	177,760.00	0.28
75	603016	新宏泰	5,200	175,552.00	0.28
76	600620	天宸股份	44,200	174,590.00	0.28
77	688416	恒烁股份	1,241	173,740.00	0.28
78	688603	天承科技	824	171,350.80	0.27
79	603989	艾华集团	3,200	168,000.00	0.27
80	002328	新朋股份	22,700	166,618.00	0.27
81	688678	福立旺	6,870	166,047.90	0.27
82	002094	青岛金王	37,900	166,002.00	0.27
83	300423	昇辉科技	30,000	165,300.00	0.26
84	300151	昌红科技	6,500	162,175.00	0.26
85	000886	海南高速	39,500	161,160.00	0.26
86	002912	中新赛克	8,700	160,428.00	0.26
87	688428	诺诚健华	5,632	160,343.04	0.26
88	003002	壶化股份	9,200	159,988.00	0.26
89	300222	科大智能	11,300	156,505.00	0.25
90	300032	金龙机电	40,800	155,040.00	0.25
91	002339	积成电子	22,300	154,539.00	0.25

92	300486	东杰智能	7,100	151,585.00	0.24
93	000753	漳州发展	33,600	150,864.00	0.24
94	603897	长城科技	4,600	149,316.00	0.24
95	000017	深中华 A	24,300	148,716.00	0.24
96	300959	线上线下	1,000	147,810.00	0.24
97	301128	强瑞技术	940	146,546.00	0.23
98	300427	红相股份	21,700	145,607.00	0.23
99	301299	卓创资讯	3,300	145,398.00	0.23
100	300792	壹网壹创	5,600	145,264.00	0.23
101	603918	金桥信息	15,300	145,044.00	0.23
102	301535	浙江华远	10,800	144,936.00	0.23
103	002765	蓝黛科技	20,800	144,768.00	0.23
104	688133	泰坦科技	6,824	144,191.12	0.23
105	301181	标榜股份	6,200	143,468.00	0.23
106	300400	劲拓股份	3,800	143,070.00	0.23
107	688084	晶品特装	2,844	142,996.32	0.23
108	001314	亿道信息	2,300	142,140.00	0.23
109	600684	珠江股份	47,000	141,470.00	0.23
110	300461	田中精机	3,800	140,752.00	0.23
111	000509	华塑控股	37,700	140,621.00	0.23
112	600594	益佰制药	47,200	140,184.00	0.22
113	002369	卓翼科技	25,800	140,094.00	0.22
114	300939	秋田微	2,000	138,400.00	0.22
115	605128	上海沿浦	5,700	138,168.00	0.22
116	603507	振江股份	4,200	138,138.00	0.22
117	688238	和元生物	25,485	138,128.70	0.22
118	600960	渤海汽车	34,200	137,826.00	0.22
119	300571	平治信息	3,000	136,980.00	0.22
120	600433	冠豪高新	42,500	136,425.00	0.22
121	300067	安诺其	25,100	136,042.00	0.22
122	300375	鹏翎股份	33,100	135,710.00	0.22
123	688365	光云科技	8,595	135,543.15	0.22
124	300259	新天科技	20,400	135,252.00	0.22
125	002343	慈文传媒	30,700	133,852.00	0.21
126	000922	佳电股份	9,540	133,178.40	0.21
127	301069	凯盛新材	6,600	132,264.00	0.21
128	300221	银禧科技	8,200	131,774.00	0.21
129	300715	凯伦股份	8,000	131,680.00	0.21
130	300071	福石控股	37,600	131,600.00	0.21
131	688435	英方软件	4,094	131,008.00	0.21
132	603829	洛凯股份	8,000	130,960.00	0.21
133	002905	金逸影视	19,300	130,275.00	0.21
134	301558	三态股份	21,000	129,570.00	0.21

135	603336	宏辉果蔬	16,300	129,096.00	0.21
136	301305	朗坤科技	4,500	128,340.00	0.21
137	603121	华培动力	10,900	128,075.00	0.21
138	300688	创业黑马	4,700	127,370.00	0.20
139	600419	天润乳业	16,800	127,176.00	0.20
140	300551	古鳌科技	12,900	126,936.00	0.20
141	300991	创益通	3,600	126,756.00	0.20
142	301190	善水科技	7,900	126,637.00	0.20
143	300174	元力股份	4,300	125,646.00	0.20
144	688168	安博通	1,827	125,606.25	0.20
145	002103	广博股份	21,300	125,031.00	0.20
146	301373	凌玮科技	800	124,400.00	0.20
147	301258	富士莱	5,400	122,958.00	0.20
148	600973	宝胜股份	17,300	122,657.00	0.20
149	920190	雷神科技	5,500	122,430.00	0.20
150	300952	恒辉安防	6,980	121,452.00	0.19
151	688020	方邦股份	484	120,806.40	0.19
152	002079	苏州固锝	8,000	120,240.00	0.19
153	600724	宁波富达	23,600	119,652.00	0.19
154	600530	ST 交昂	24,100	118,813.00	0.19
155	002342	巨力索具	11,300	118,763.00	0.19
156	688239	航宇科技	1,973	118,044.59	0.19
157	688244	永信至诚	8,273	117,972.98	0.19
158	300279	和晶科技	19,400	117,370.00	0.19
159	300250	初灵信息	8,000	116,640.00	0.19
160	688499	利元亨	2,210	116,135.50	0.19
161	688667	菱电电控	863	115,339.95	0.18
162	002955	鸿合科技	3,200	114,400.00	0.18
163	301538	骏鼎达	2,260	113,836.20	0.18
164	688155	先惠技术	1,401	113,326.89	0.18
165	600237	铜峰电子	8,100	112,995.00	0.18
166	688231	隆达股份	3,076	112,981.48	0.18
167	688699	明微电子	1,372	112,435.40	0.18
168	688170	德龙激光	1,167	112,043.67	0.18
169	002692	远程股份	29,700	111,969.00	0.18
170	688079	美迪凯	3,601	110,730.75	0.18
171	301382	蜂助手	2,400	110,400.00	0.18
172	002826	易明医药	7,300	109,719.00	0.18
173	002559	亚威股份	8,600	109,306.00	0.18
174	600527	江南高纤	51,000	109,140.00	0.17
175	600846	同济科技	10,900	109,000.00	0.17
176	300975	商络电子	2,100	108,675.00	0.17
177	002057	中钢天源	8,700	108,141.00	0.17

178	002418	康盛股份	27,400	107,956.00	0.17
179	600488	津药药业	22,200	107,226.00	0.17
180	300288	朗玛信息	12,000	106,800.00	0.17
181	002278	神开股份	14,100	106,314.00	0.17
182	002655	共达电声	2,300	105,800.00	0.17
183	300121	阳谷华泰	8,300	104,580.00	0.17
184	301178	天亿马	2,100	104,475.00	0.17
185	300592	华凯易佰	5,900	104,430.00	0.17
186	603668	天马科技	8,200	103,812.00	0.17
187	002860	星帅尔	7,100	103,589.00	0.17
188	001208	华菱线缆	7,300	103,587.00	0.17
189	688419	耐科装备	1,317	103,582.05	0.17
190	002191	劲嘉股份	26,300	102,833.00	0.16
191	688625	呈和科技	1,218	102,811.38	0.16
192	300683	海特生物	4,100	102,541.00	0.16
193	301176	逸豪新材	1,500	102,000.00	0.16
194	603069	海汽集团	8,100	101,655.00	0.16
195	603969	银龙股份	13,900	101,053.00	0.16
196	001223	欧克科技	1,900	100,947.00	0.16
197	301568	思泰克	900	100,440.00	0.16
198	300985	致远新能	2,600	100,100.00	0.16
199	300465	高伟达	9,100	99,463.00	0.16
200	688386	泛亚微透	1,105	99,273.20	0.16
201	002264	新华都	17,600	99,264.00	0.16
202	301517	陕西华达	2,000	99,260.00	0.16
203	600966	博汇纸业	20,700	98,946.00	0.16
204	920576	天力复合	1,600	98,880.00	0.16
205	002772	众兴菌业	8,700	98,832.00	0.16
206	002580	圣阳股份	4,900	98,784.00	0.16
207	002725	跃岭股份	8,000	98,560.00	0.16
208	600826	兰生股份	11,200	98,448.00	0.16
209	600630	龙头股份	10,100	98,374.00	0.16
210	300511	雪榕生物	19,500	98,085.00	0.16
211	002615	哈尔斯	14,200	97,980.00	0.16
212	000812	陕西金叶	31,600	97,960.00	0.16
213	301323	新莱福	1,200	97,908.00	0.16
214	600603	广汇物流	22,500	97,875.00	0.16
215	603088	宁波精达	9,700	97,582.00	0.16
216	001288	运机集团	4,100	97,539.00	0.16
217	300399	天利科技	5,100	97,308.00	0.16
218	688093	世华科技	2,632	97,120.80	0.16
219	688399	硕世生物	2,130	96,680.70	0.15
220	002682	龙洲股份	22,800	96,672.00	0.15

221	002022	科华生物	21,100	96,638.00	0.15
222	300945	曼卡龙	8,900	96,387.00	0.15
223	688665	四方光电	1,466	96,316.20	0.15
224	688677	海泰新光	952	96,275.76	0.15
225	300791	仙乐健康	6,000	96,120.00	0.15
226	603878	武进不锈	18,700	96,118.00	0.15
227	300350	华鹏飞	24,200	96,074.00	0.15
228	301111	粤万年青	3,700	95,756.00	0.15
229	300774	倍杰特	8,900	95,675.00	0.15
230	003040	楚天龙	9,000	95,580.00	0.15
231	920790	联迪信息	3,800	95,494.00	0.15
232	603312	西典新能	2,800	95,144.00	0.15
233	002811	郑中设计	8,500	95,115.00	0.15
234	002990	盛视科技	1,200	94,800.00	0.15
234	920522	纳科诺尔	4,000	94,800.00	0.15
235	301329	信音电子	3,900	94,731.00	0.15
236	600650	锦江在线	9,800	94,472.00	0.15
237	300947	德必集团	7,400	94,350.00	0.15
238	603097	江苏华辰	3,500	93,765.00	0.15
239	688171	纬德信息	2,124	93,371.04	0.15
240	603499	翔港科技	7,100	93,365.00	0.15
241	002919	名臣健康	4,900	93,051.00	0.15
242	002614	奥佳华	20,900	92,378.00	0.15
243	688621	阳光诺和	1,678	92,138.98	0.15
244	001360	南矿集团	5,200	91,988.00	0.15
245	301362	民爆光电	500	91,960.00	0.15
246	301169	零点有数	1,300	91,858.00	0.15
247	300960	通业科技	5,900	91,745.00	0.15
248	600693	东百集团	11,700	91,728.00	0.15
249	600903	贵州燃气	13,800	91,632.00	0.15
250	301279	金道科技	4,200	91,266.00	0.15
251	002054	德美化工	13,600	90,440.00	0.14
252	603677	奇精机械	7,000	89,950.00	0.14
253	301152	天力锂能	3,800	89,946.00	0.14
254	301636	泽润新能	2,100	88,431.00	0.14
255	300005	探路者	3,900	88,140.00	0.14
256	002561	徐家汇	14,400	88,128.00	0.14
257	300559	佳发教育	8,400	85,932.00	0.14
258	002394	联发股份	9,600	85,632.00	0.14
259	300805	电声股份	11,800	85,550.00	0.14
260	920682	球冠电缆	14,500	84,680.00	0.14
261	603315	福鞍股份	5,600	83,888.00	0.13
262	002587	奥拓电子	10,600	82,786.00	0.13

263	605299	舒华体育	6,200	82,770.00	0.13
264	601789	宁波建工	20,600	82,606.00	0.13
265	600545	卓郎智能	10,200	82,110.00	0.13
266	605056	咸亨国际	5,100	81,600.00	0.13
267	002491	通鼎互联	2,500	81,000.00	0.13
268	002787	华源控股	2,500	80,500.00	0.13
269	002206	海利得	15,500	80,135.00	0.13
270	300542	新晨科技	7,100	78,668.00	0.13
271	002918	蒙娜丽莎	7,800	78,390.00	0.13
272	300703	创源股份	6,100	77,897.00	0.12
273	300863	卡倍亿	1,000	76,630.00	0.12
274	300471	厚普股份	8,900	76,629.00	0.12
275	301007	德迈仕	2,500	76,500.00	0.12
276	300217	东方电热	17,800	76,006.00	0.12
277	688378	奥来德	1,218	75,516.00	0.12
278	000635	英力特	12,500	75,500.00	0.12
279	300988	津荣天宇	4,800	75,024.00	0.12
280	603912	佳力图	9,600	74,688.00	0.12
281	000705	浙江震元	12,700	74,295.00	0.12
282	603758	秦安股份	8,100	72,414.00	0.12
283	603289	泰瑞机器	8,900	71,823.00	0.12
284	605338	巴比食品	4,000	71,600.00	0.11
285	301397	溯联股份	2,200	71,192.00	0.11
286	300781	因赛集团	2,700	71,172.00	0.11
287	301320	豪江智能	5,500	70,950.00	0.11
288	000949	新乡化纤	11,100	70,374.00	0.11
289	603400	华之杰	1,300	70,226.00	0.11
290	000417	合百集团	8,000	70,000.00	0.11
291	002980	华盛昌	600	69,924.00	0.11
292	300025	华星创业	16,600	69,720.00	0.11
293	301326	捷邦科技	500	69,685.00	0.11
294	301383	天键股份	2,900	69,310.00	0.11
295	002769	普路通	10,600	69,218.00	0.11
296	688609	九联科技	6,283	69,175.83	0.11
297	301136	招标股份	6,300	69,174.00	0.11
298	688693	锆威特	665	69,126.75	0.11
299	001379	腾达科技	4,400	69,080.00	0.11
300	002066	瑞泰科技	3,300	68,739.00	0.11
301	600336	澳柯玛	11,000	68,530.00	0.11
302	300227	光韵达	5,700	67,830.00	0.11
303	603186	华正新材	300	67,590.00	0.11
304	002628	成都路桥	12,600	67,410.00	0.11
305	300834	星辉环材	1,600	66,880.00	0.11

306	300531	优博讯	4,400	66,660.00	0.11
307	605287	德才股份	1,600	66,384.00	0.11
308	002584	西陇科学	7,000	66,360.00	0.11
309	300756	金马游乐	2,000	66,100.00	0.11
310	300916	朗特智能	2,800	65,436.00	0.10
311	300986	志特新材	3,800	65,170.00	0.10
312	002380	科远智慧	1,900	64,942.00	0.10
313	002519	银河电子	11,000	64,350.00	0.10
314	002849	威星智能	3,800	64,296.00	0.10
315	300612	宣亚国际	5,800	63,394.00	0.10
316	300940	南极光	4,200	63,336.00	0.10
317	300745	欣锐科技	1,500	63,330.00	0.10
318	603285	键邦股份	1,400	62,734.00	0.10
319	002016	世荣兆业	15,600	62,400.00	0.10
320	002843	泰嘉股份	2,900	62,263.00	0.10
321	000863	三湘印象	14,800	62,160.00	0.10
322	600103	青山纸业	20,200	62,014.00	0.10
323	603216	梦天家居	3,000	61,710.00	0.10
324	002108	沧州明珠	14,800	61,272.00	0.10
325	600796	钱江生化	13,200	61,248.00	0.10
326	603759	海天股份	8,900	61,232.00	0.10
327	002478	常宝股份	9,900	61,182.00	0.10
328	003018	金富科技	800	60,984.00	0.10
329	002297	博云新材	2,100	60,879.00	0.10
330	301085	亚康股份	1,000	60,610.00	0.10
331	301307	美利信	800	60,232.00	0.10
332	300510	金冠股份	19,300	60,216.00	0.10
333	301188	力诺药包	900	60,210.00	0.10
334	300306	远方信息	6,200	60,140.00	0.10
335	300636	同和药业	9,400	59,878.00	0.10
336	002446	盛路通信	5,500	59,070.00	0.09
337	300941	创识科技	4,300	59,039.00	0.09
338	000036	华联控股	13,500	58,995.00	0.09
339	301248	杰创智能	700	58,751.00	0.09
340	605068	明新旭腾	3,500	58,730.00	0.09
341	301378	通达海	2,400	57,552.00	0.09
342	688292	浩瀚深度	3,060	56,916.00	0.09
343	000968	蓝焰控股	9,500	56,905.00	0.09
344	300787	海能实业	6,200	56,544.00	0.09
345	003020	立方制药	3,800	56,278.00	0.09
346	300445	康斯特	2,700	56,214.00	0.09
347	300145	南方泵业	10,300	56,135.00	0.09
348	688210	统联精密	1,379	55,863.29	0.09

349	000593	德龙汇能	2,600	55,588.00	0.09
350	301052	果麦文化	2,500	55,550.00	0.09
351	688628	优利德	556	55,010.64	0.09
352	002957	科瑞技术	1,000	54,840.00	0.09
353	301093	华兰股份	400	54,252.00	0.09
354	001217	华尔泰	6,400	53,952.00	0.09
355	301011	华立科技	3,800	53,732.00	0.09
356	688268	华特气体	200	53,500.00	0.09
357	301560	众捷汽车	2,000	53,460.00	0.09
358	688071	华依科技	1,442	52,546.48	0.08
359	688661	和林微纳	325	51,668.50	0.08
360	301083	百胜智能	3,900	51,363.00	0.08
361	605108	同庆楼	4,500	51,120.00	0.08
362	603680	今创集团	5,200	51,012.00	0.08
363	300532	今天国际	8,180	50,961.40	0.08
364	601121	宝地矿业	9,000	50,760.00	0.08
365	002098	浔兴股份	7,900	50,560.00	0.08
366	603701	德宏股份	2,300	50,554.00	0.08
367	603061	金海通	100	50,222.00	0.08
368	300420	五洋自控	5,300	50,138.00	0.08
369	300862	蓝盾光电	2,400	50,016.00	0.08
370	688602	康鹏科技	6,346	50,006.48	0.08
371	000797	中国武夷	22,800	49,932.00	0.08
372	301066	万事利	4,300	49,923.00	0.08
373	688651	盛邦安全	1,540	49,618.80	0.08
374	601007	金陵饭店	8,100	49,491.00	0.08
375	002021	中捷资源	19,500	49,140.00	0.08
375	002578	闽发铝业	15,600	49,140.00	0.08
376	002943	宇晶股份	1,110	49,095.30	0.08
377	300018	中元股份	3,900	48,165.00	0.08
378	688556	高测股份	3,585	47,608.80	0.08
379	300879	大叶股份	3,000	47,040.00	0.08
380	688143	长盈通	267	46,959.96	0.08
381	300938	信测标准	940	46,887.20	0.08
382	300547	川环科技	1,400	46,746.00	0.07
383	001388	信通电子	1,700	46,699.00	0.07
384	002361	神剑股份	3,100	46,655.00	0.07
385	002208	合肥城建	2,300	46,506.00	0.07
386	300835	龙磁科技	200	45,898.00	0.07
387	300042	朗科科技	600	45,702.00	0.07
388	002134	天津普林	1,500	45,630.00	0.07
389	688090	瑞松科技	426	45,347.70	0.07
390	688711	宏微科技	977	44,404.65	0.07

391	601599	浙文影业	15,900	44,361.00	0.07
392	600222	太龙药业	6,100	44,286.00	0.07
393	301070	开勒股份	500	44,000.00	0.07
394	688590	新致软件	3,501	43,517.43	0.07
395	603222	济民健康	5,100	43,095.00	0.07
396	301117	佳缘科技	1,840	42,964.00	0.07
397	002970	锐明技术	800	42,744.00	0.07
398	688312	燕麦科技	507	42,582.93	0.07
399	605136	丽人丽妆	5,900	42,067.00	0.07
400	300179	四方达	700	41,601.00	0.07
401	301567	贝隆精密	1,200	41,532.00	0.07
402	603095	越剑智能	2,900	41,528.00	0.07
403	002899	英派斯	1,900	41,420.00	0.07
404	001311	多利科技	2,560	41,292.80	0.07
405	000925	众合科技	4,400	41,096.00	0.07
406	600397	江钨装备	1,500	40,845.00	0.07
407	688273	麦澜德	1,049	40,638.26	0.07
408	688275	万润新能	318	40,560.90	0.06
409	300700	岱勒新材	1,900	40,432.00	0.06
410	603273	天元智能	3,100	40,145.00	0.06
411	002148	北纬科技	6,900	40,089.00	0.06
412	600467	好当家	20,300	39,991.00	0.06
413	301292	海科新源	500	39,865.00	0.06
414	003043	华亚智能	400	39,756.00	0.06
415	000510	新金路	1,600	39,744.00	0.06
416	300790	宇瞳光学	1,520	39,687.20	0.06
417	002766	索菱股份	11,200	39,536.00	0.06
418	002132	恒星科技	7,300	39,493.00	0.06
419	301590	优优绿能	300	39,435.00	0.06
420	000850	华茂股份	11,100	38,961.00	0.06
421	688135	利扬芯片	919	38,671.52	0.06
422	002169	智光电气	2,600	38,064.00	0.06
423	688325	赛微微电	291	37,949.31	0.06
424	301150	中一科技	600	37,866.00	0.06
425	300984	金沃股份	700	37,611.00	0.06
426	601616	广电电气	11,000	37,510.00	0.06
427	300041	回天新材	2,400	37,296.00	0.06
428	603031	安孚科技	700	37,275.00	0.06
429	688787	海天瑞声	277	37,242.65	0.06
430	300836	佰奥智能	500	36,995.00	0.06
431	688595	芯海科技	841	36,886.26	0.06
432	300553	集智股份	600	36,834.00	0.06
433	301516	中远通	2,600	36,790.00	0.06

434	603633	徕木股份	5,400	36,774.00	0.06
435	002135	东南网架	5,400	36,666.00	0.06
436	300937	药易购	1,900	36,651.00	0.06
437	301021	英诺激光	300	36,570.00	0.06
438	301226	祥明智能	1,100	36,509.00	0.06
439	301557	常友科技	400	36,364.00	0.06
440	688176	亚虹医药	3,661	36,317.12	0.06
441	688722	同益中	2,386	36,195.62	0.06
442	301013	利和兴	500	36,125.00	0.06
443	601388	怡球资源	12,700	35,941.00	0.06
444	688010	福光股份	739	35,937.57	0.06
445	003019	宸展光电	1,100	35,805.00	0.06
446	603629	利通电子	200	35,762.00	0.06
447	600520	三佳科技	900	35,739.00	0.06
448	688707	振华新材	2,781	35,735.85	0.06
449	002083	孚日股份	3,400	35,666.00	0.06
450	603722	阿科力	900	35,640.00	0.06
450	603931	格林达	600	35,640.00	0.06
451	688230	芯导科技	450	35,464.50	0.06
452	605168	三人行	700	35,448.00	0.06
453	300189	神农种业	8,200	35,424.00	0.06
454	301608	博实结	700	35,182.00	0.06
455	688501	青达环保	1,829	35,116.80	0.06
456	002440	闰土股份	3,400	34,850.00	0.06
457	300900	广联航空	900	34,713.00	0.06
458	002210	飞马国际	16,300	34,556.00	0.06
459	300508	维宏股份	600	34,458.00	0.06
460	300314	戴维医疗	3,700	34,447.00	0.06
461	600477	杭萧钢构	14,900	34,419.00	0.06
462	300491	通合科技	900	34,371.00	0.06
463	300828	锐新科技	1,700	34,323.00	0.05
464	300132	诺斯贝尔	6,000	34,080.00	0.05
465	688373	盟科药业	7,522	34,074.66	0.05
466	603269	海鸥股份	2,060	33,928.20	0.05
467	002640	跨境通	11,200	33,712.00	0.05
468	603085	天成自控	3,100	33,697.00	0.05
469	301239	普瑞眼科	1,100	33,495.00	0.05
470	300473	德尔股份	1,100	33,440.00	0.05
471	000816	智慧农业	14,500	33,350.00	0.05
472	300885	海昌新材	1,400	33,278.00	0.05
473	301082	久盛电气	3,700	33,152.00	0.05
474	603011	合锻智能	1,000	33,080.00	0.05
475	688360	德马科技	1,847	33,061.30	0.05

476	002562	兄弟科技	7,600	33,060.00	0.05
477	300351	永贵电器	2,000	33,000.00	0.05
478	600860	京城股份	4,000	32,960.00	0.05
479	600400	红豆股份	10,000	32,900.00	0.05
480	603081	大丰实业	3,800	32,870.00	0.05
481	300902	国安达	2,000	32,780.00	0.05
482	001306	夏厦精密	600	32,742.00	0.05
483	300584	海辰药业	900	32,607.00	0.05
484	002419	天虹股份	7,700	32,571.00	0.05
485	600052	东望时代	9,200	32,568.00	0.05
486	600067	冠城新材	11,200	32,480.00	0.05
487	000520	凤凰航运	8,700	32,451.00	0.05
488	603020	爱普股份	2,300	32,430.00	0.05
489	300389	艾比森	2,500	32,050.00	0.05
490	688626	翔宇医疗	722	31,955.72	0.05
491	688246	嘉和美康	1,555	31,955.25	0.05
492	002686	亿利达	6,200	31,930.00	0.05
493	301028	鼎熔岩	2,000	31,920.00	0.05
494	300608	思特奇	3,100	31,899.00	0.05
495	600880	博瑞传播	8,600	31,820.00	0.05
496	002903	宇环数控	700	31,794.00	0.05
497	688070	纵横股份	849	31,693.17	0.05
498	301595	太力科技	800	31,680.00	0.05
499	001317	三羊马	800	31,664.00	0.05
500	603949	雪龙集团	1,800	31,536.00	0.05
501	301439	泓淋电力	2,000	31,440.00	0.05
502	603390	通达电气	3,000	31,320.00	0.05
503	002660	茂硕电源	4,800	31,200.00	0.05
504	601226	华电科工	4,900	31,164.00	0.05
505	300240	飞力达	6,200	30,938.00	0.05
506	600470	六国化工	5,300	30,740.00	0.05
507	688500	慧辰股份	676	30,643.08	0.05
508	301162	国能日新	700	30,625.00	0.05
509	688529	豪森智能	1,939	30,500.47	0.05
510	603178	圣龙股份	2,200	30,470.00	0.05
511	605580	恒盛能源	1,100	30,371.00	0.05
512	605500	森林包装	4,900	30,282.00	0.05
513	688601	力芯微	500	30,275.00	0.05
514	301235	华康洁净	400	30,004.00	0.05
515	301202	朗威股份	900	29,997.00	0.05
516	603618	杭电股份	600	29,928.00	0.05
517	301151	冠龙节能	1,800	29,700.00	0.05
518	300818	耐普矿机	1,570	29,673.00	0.05

519	301566	达利凯普	800	29,664.00	0.05
520	301468	博盈特焊	710	29,614.10	0.05
521	300485	赛升药业	3,100	29,481.00	0.05
522	002782	可立克	1,400	29,470.00	0.05
523	300909	汇创达	500	29,110.00	0.05
524	920839	万通液压	1,100	28,787.00	0.05
525	301280	珠城科技	560	28,319.20	0.05
526	603777	来伊份	1,800	27,954.00	0.04
527	688456	有研粉材	200	27,920.00	0.04
528	301199	迈赫股份	1,600	27,904.00	0.04
529	603790	雅运股份	1,300	27,742.00	0.04
530	301387	光大同创	300	27,726.00	0.04
531	300545	联得装备	600	27,720.00	0.04
532	002666	德联集团	7,000	27,650.00	0.04
533	002443	金洲管道	2,900	27,637.00	0.04
534	301360	荣旗科技	400	27,396.00	0.04
535	002986	宇新股份	2,300	27,209.00	0.04
536	300105	龙源技术	3,800	26,866.00	0.04
537	688636	智明达	738	26,737.74	0.04
538	300283	温州宏丰	1,300	26,715.00	0.04
539	003007	直真科技	700	26,320.00	0.04
540	300956	英力股份	2,300	25,852.00	0.04
541	002803	吉宏股份	1,000	25,840.00	0.04
542	300681	英搏尔	900	25,758.00	0.04
543	603617	君禾股份	3,600	25,632.00	0.04
544	605028	世茂能源	1,200	25,560.00	0.04
545	603110	东方材料	1,100	25,487.00	0.04
546	600785	新华百货	2,600	25,480.00	0.04
547	300798	锦鸡股份	3,900	25,467.00	0.04
548	600396	华电辽能	1,700	25,432.00	0.04
549	300382	斯莱克	1,100	25,421.00	0.04
550	688299	长阳科技	1,517	25,349.07	0.04
551	603151	邦基科技	2,300	25,277.00	0.04
552	002445	中南文化	8,900	25,276.00	0.04
553	001222	源飞宠物	1,900	25,232.00	0.04
554	603535	嘉诚国际	4,200	25,158.00	0.04
555	000700	模塑科技	1,700	25,092.00	0.04
556	002879	长缆科技	1,900	24,947.00	0.04
557	000607	华媒控股	8,100	24,867.00	0.04
558	301366	一博科技	400	24,468.00	0.04
559	603158	腾龙股份	2,000	24,460.00	0.04
560	603800	洪田股份	300	24,387.00	0.04
561	002824	和胜股份	700	24,206.00	0.04

562	688381	帝奥微	447	23,914.50	0.04
563	300976	达瑞电子	300	23,895.00	0.04
564	688663	新风光	266	23,530.36	0.04
565	300501	海顺新材	1,800	22,860.00	0.04
566	300632	光莆股份	800	22,840.00	0.04
567	300247	融捷健康	6,100	22,387.00	0.04
568	301016	雷尔伟	1,600	22,352.00	0.04
569	300232	洲明科技	3,900	22,347.00	0.04
570	688109	品茗科技	295	22,331.50	0.04
571	002334	英威腾	3,100	21,979.00	0.04
572	603657	春光科技	800	21,784.00	0.03
573	688589	力合微	946	21,739.08	0.03
574	600824	益民集团	6,600	21,714.00	0.03
575	301399	英特科技	1,300	21,424.00	0.03
576	300331	苏大维格	300	21,333.00	0.03
577	301251	威尔高	400	21,312.00	0.03
578	688334	西高院	1,171	21,241.94	0.03
579	300263	隆华科技	1,300	21,190.00	0.03
580	605100	华丰股份	520	21,018.40	0.03
581	002730	电光科技	700	20,937.00	0.03
582	301141	中科磁业	500	20,930.00	0.03
583	301312	智立方	180	20,881.80	0.03
584	603601	再升科技	1,700	20,876.00	0.03
585	300696	爱乐达	800	20,824.00	0.03
586	688598	金博股份	421	20,818.45	0.03
587	300384	三联虹普	1,800	20,520.00	0.03
587	603798	康普顿	1,500	20,520.00	0.03
588	603916	苏博特	1,500	20,490.00	0.03
589	920368	连城数控	700	20,447.00	0.03
590	002427	尤夫股份	4,000	20,160.00	0.03
591	605588	冠石科技	300	20,151.00	0.03
592	002551	尚荣医疗	7,500	20,025.00	0.03
593	300213	佳讯飞鸿	3,300	19,998.00	0.03
594	300921	南凌科技	980	19,903.80	0.03
595	300110	华仁药业	8,000	19,840.00	0.03
596	300891	惠云钛业	3,100	19,623.00	0.03
597	603611	诺力股份	1,200	19,428.00	0.03
598	600558	大西洋	3,900	19,266.00	0.03
599	300720	海川智能	200	19,240.00	0.03
600	300656	民德电子	500	19,045.00	0.03
601	001212	中旗新材	400	18,952.00	0.03
602	600367	红星发展	300	18,879.00	0.03
603	002449	国星光电	2,400	18,600.00	0.03

604	300206	理邦仪器	1,500	18,345.00	0.03
605	301229	纽泰格	1,500	18,180.00	0.03
606	301479	弘景光电	300	18,060.00	0.03
607	688550	瑞联新材	312	18,049.20	0.03
608	603738	泰晶科技	300	18,015.00	0.03
609	002438	江苏神通	1,200	17,916.00	0.03
610	300292	吴通控股	3,300	17,886.00	0.03
611	300842	帝科股份	200	17,834.00	0.03
612	688719	爱科赛博	231	17,787.00	0.03
613	688478	晶升股份	200	17,710.00	0.03
614	300562	乐心医疗	1,300	17,563.00	0.03
615	002522	浙江众成	2,200	17,534.00	0.03
616	003041	真爱美家	400	17,460.00	0.03
617	605166	聚合顺	1,800	17,262.00	0.03
618	002404	嘉欣丝绸	3,000	17,160.00	0.03
619	605277	新亚电子	900	17,154.00	0.03
620	301062	上海艾录	3,000	17,130.00	0.03
621	300709	精研科技	300	16,875.00	0.03
622	603817	海峡环保	3,300	16,863.00	0.03
623	603270	金帝股份	500	16,755.00	0.03
624	688579	地纬智能	2,201	16,705.59	0.03
625	301252	同星科技	400	16,212.00	0.03
626	300619	金银河	520	16,177.20	0.03
627	301322	绿通科技	300	16,005.00	0.03
628	300691	联合光电	1,000	15,810.00	0.03
629	688103	国力电子	212	15,774.92	0.03
630	301507	民生健康	1,300	15,639.00	0.03
631	300746	汉嘉数智	1,400	15,134.00	0.02
632	688768	容知日新	292	15,049.68	0.02
633	600300	维维股份	5,300	14,946.00	0.02
634	688028	沃尔德	94	14,651.78	0.02
635	300816	艾可蓝	200	14,640.00	0.02
636	603004	鼎龙科技	600	14,454.00	0.02
637	300701	森霸传感	1,500	14,355.00	0.02
638	605488	福莱新材	500	14,180.00	0.02
639	688112	鼎阳科技	193	14,177.78	0.02
640	300424	航新科技	900	14,166.00	0.02
641	301525	儒竞科技	300	14,163.00	0.02
642	603150	万朗磁塑	200	14,160.00	0.02
643	301580	爱迪特	220	14,152.60	0.02
644	605077	华康股份	1,300	14,053.00	0.02
645	002106	莱宝高科	800	14,016.00	0.02
645	300404	博济医药	1,600	14,016.00	0.02

646	002358	森源电气	2,500	13,875.00	0.02
647	603381	永臻股份	900	13,869.00	0.02
648	300858	科拓生物	900	13,671.00	0.02
649	688757	胜科纳米	200	13,340.00	0.02
650	600288	大恒科技	1,000	13,300.00	0.02
651	002090	金智科技	1,500	13,260.00	0.02
652	002398	垒知集团	3,500	13,125.00	0.02
653	002515	金字火腿	1,300	13,013.00	0.02
654	300480	光力科技	300	12,804.00	0.02
655	002576	通达动力	900	12,735.00	0.02
656	002283	天润工业	1,300	12,545.00	0.02
657	300304	云意电气	700	12,495.00	0.02
658	600784	鲁银投资	1,900	12,350.00	0.02
659	002923	润都股份	1,300	12,298.00	0.02
660	300299	富春股份	2,500	12,250.00	0.02
661	002554	惠博普	3,900	12,168.00	0.02
662	300933	中辰股份	2,000	12,160.00	0.02
663	688767	博拓生物	373	12,126.23	0.02
664	002392	北京利尔	1,500	12,105.00	0.02
665	688458	美芯晟	288	12,026.88	0.02
666	002026	山东威达	1,100	11,880.00	0.02
667	002902	铭普光磁	400	11,864.00	0.02
668	002228	合兴包装	4,000	11,760.00	0.02
669	002489	浙江永强	4,300	11,653.00	0.02
670	688073	毕得医药	216	11,625.12	0.02
671	300499	高澜股份	300	11,610.00	0.02
672	002774	快意电梯	800	11,368.00	0.02
673	301067	显盈科技	300	11,346.00	0.02
674	000819	岳阳兴长	1,000	11,330.00	0.02
675	001215	千味央厨	300	11,070.00	0.02
676	603890	春秋电子	400	11,048.00	0.02
677	002718	友邦吊顶	100	11,025.00	0.02
678	603391	力聚热能	200	10,876.00	0.02
679	605169	洪通燃气	1,200	10,668.00	0.02
680	002940	昂利康	400	10,564.00	0.02
681	301398	星源卓镁	300	10,533.00	0.02
682	300358	楚天科技	1,300	10,400.00	0.02
683	300575	中旗股份	2,100	10,332.00	0.02
684	600769	祥龙电业	500	10,255.00	0.02
685	603090	宏盛股份	200	10,212.00	0.02
686	300332	天壕能源	2,300	9,890.00	0.02
687	002296	辉煌科技	1,100	9,768.00	0.02
688	603002	宏昌电子	400	9,668.00	0.02

689	605208	永茂泰	600	9,570.00	0.02
690	301099	雅创电子	100	9,550.00	0.02
691	003036	泰坦股份	100	9,249.00	0.01
692	605366	宏柏新材	700	9,121.00	0.01
693	300611	美力科技	400	9,068.00	0.01
694	002632	道明光学	1,000	9,010.00	0.01
695	002935	天奥电子	400	8,776.00	0.01
696	002703	浙江世宝	600	8,538.00	0.01
697	300606	金太阳	200	8,512.00	0.01
698	605305	中际联合	200	8,384.00	0.01
699	000533	顺钠股份	700	6,657.00	0.01
700	300335	迪森股份	500	2,435.00	0.00
701	300429	强力新材	100	1,772.00	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	688668	鼎通科技	407	151,933.10	0.24
2	002484	江海股份	1,400	147,000.00	0.24
3	000959	首钢股份	38,700	135,837.00	0.22
4	300839	博汇股份	11,100	129,981.00	0.21
5	688141	杰华特	802	123,107.00	0.20
6	301165	锐捷网络	1,400	112,630.00	0.18
7	300723	一品红	2,800	104,384.00	0.17
8	688396	华润微	1,041	101,549.55	0.16
9	300661	圣邦股份	700	100,436.00	0.16
10	300570	太辰光	400	98,684.00	0.16
11	688025	杰普特	200	94,000.00	0.15
12	003027	同兴科技	5,200	90,636.00	0.15
13	301536	星辰科技	700	90,097.00	0.14
14	688183	生益电子	667	88,310.80	0.14
15	600176	中国巨石	1,200	87,456.00	0.14
16	002858	力盛体育	7,900	86,189.00	0.14
17	600166	福田汽车	29,200	84,972.00	0.14
18	300857	协创数据	240	81,576.00	0.13
19	688519	南亚新材	212	80,568.48	0.13
20	301526	国际复材	1,700	79,339.00	0.13
21	605318	法狮龙	700	79,002.00	0.13
22	688517	金冠电气	4,408	77,051.84	0.12
23	688531	日联科技	421	74,870.64	0.12
24	002792	通宇通讯	1,800	64,026.00	0.10
25	603063	禾望电气	1,200	63,468.00	0.10
26	002396	星网锐捷	3,270	62,685.90	0.10
27	301381	赛维时代	3,300	60,852.00	0.10

28	000967	盈峰环境	5,600	58,968.00	0.09
29	002048	宁波华翔	2,300	52,900.00	0.08
30	000725	京东方 A	6,000	52,080.00	0.08
31	603183	建研院	14,600	51,830.00	0.08
32	600256	广汇能源	10,400	51,376.00	0.08
33	600577	精达股份	5,200	50,856.00	0.08
34	002475	立讯精密	700	49,280.00	0.08
35	688395	正弦电气	2,228	49,238.80	0.08
36	002364	中恒电气	900	48,420.00	0.08
37	301390	经纬股份	1,500	48,390.00	0.08
38	688718	唯赛勃	2,993	47,798.21	0.08
39	603612	索通发展	2,600	47,138.00	0.08
40	002947	恒铭达	600	45,630.00	0.07
41	688329	艾隆科技	2,214	44,744.94	0.07
42	688234	天岳先进	256	44,418.56	0.07
43	688220	翱捷科技	352	43,760.64	0.07
44	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.07
45	002245	蔚蓝锂芯	2,300	43,033.00	0.07
46	300049	福瑞医科	1,100	42,768.00	0.07
47	688607	康众医疗	831	42,381.00	0.07
48	002909	集泰股份	8,500	41,990.00	0.07
49	300935	盈建科	1,400	41,076.00	0.07
50	688429	时创能源	4,026	41,024.94	0.07
51	688203	海正生材	4,053	40,448.94	0.06
52	002929	润建股份	600	40,128.00	0.06
53	688571	杭华股份	4,562	39,917.50	0.06
54	002429	兆驰股份	3,800	39,482.00	0.06
55	605055	迎丰股份	3,800	38,760.00	0.06
56	000338	潍柴动力	1,400	38,150.00	0.06
57	600371	万向德农	6,000	37,500.00	0.06
58	002081	金螳螂	8,500	36,805.00	0.06
59	600391	航发科技	1,100	36,795.00	0.06
60	002290	禾盛新材	400	36,748.00	0.06
61	603909	建发合诚	4,300	36,679.00	0.06
62	002922	伊戈尔	1,100	36,080.00	0.06
63	301611	珂玛科技	200	36,014.00	0.06
64	600010	宝钢股份	16,100	35,903.00	0.06
65	688096	京源环保	2,676	35,751.36	0.06
66	688779	五矿新能	4,371	35,448.81	0.06
67	301095	广立微	300	35,415.00	0.06
68	688058	宝兰德	1,674	35,020.08	0.06
69	600362	江西铜业	800	34,640.00	0.06
70	605158	华达新材	5,400	34,560.00	0.06

71	000811	冰轮环境	600	33,732.00	0.05
72	688409	富创精密	110	33,687.50	0.05
73	300806	斯迪克	300	33,600.00	0.05
74	688006	杭可科技	918	33,552.90	0.05
75	605218	伟时电子	2,000	33,060.00	0.05
76	300782	卓胜微	300	32,874.00	0.05
77	002859	洁美科技	300	32,853.00	0.05
78	300564	筑博设计	2,700	32,427.00	0.05
79	601615	明阳智能	2,800	32,396.00	0.05
80	300418	昆仑万维	800	32,288.00	0.05
81	002723	小崧股份	3,600	31,824.00	0.05
82	601126	四方股份	500	31,600.00	0.05
83	601958	金钼股份	1,100	30,921.00	0.05
84	603017	中衡设计	3,100	30,845.00	0.05
85	688390	固德威	284	30,816.84	0.05
86	603179	新泉股份	620	30,783.00	0.05
87	300684	中石科技	500	30,500.00	0.05
88	688167	炬光科技	86	30,462.06	0.05
89	002008	大族激光	200	30,022.00	0.05
90	300672	国科微	100	29,500.00	0.05
91	300977	深圳瑞捷	1,900	29,298.00	0.05
92	002536	飞龙股份	600	28,308.00	0.05
93	600359	新农开发	5,100	27,540.00	0.04
94	601872	招商轮船	1,500	26,355.00	0.04
95	301272	英华特	800	26,352.00	0.04
96	688217	睿昂基因	1,229	25,391.14	0.04
97	300136	信维通信	200	23,850.00	0.04
98	688310	迈得医疗	1,550	23,823.50	0.04
99	603091	众鑫股份	480	23,409.60	0.04
100	603067	振华股份	500	23,145.00	0.04
101	002215	诺普信	2,800	23,044.00	0.04
102	600552	凯盛科技	700	22,806.00	0.04
103	000985	大庆华科	1,600	22,768.00	0.04
104	603320	迪贝电气	1,300	22,685.00	0.04
105	688466	金科环境	1,734	22,247.22	0.04
106	301273	瑞晨环保	700	22,057.00	0.04
107	600773	西藏城投	1,700	21,879.00	0.04
108	600589	大位科技	2,100	21,504.00	0.03
109	301486	致尚科技	100	20,832.00	0.03
110	603306	华懋科技	200	20,738.00	0.03
111	000938	紫光股份	700	20,202.00	0.03
112	300115	长盈精密	700	19,558.00	0.03
113	300610	晨化股份	2,000	19,500.00	0.03

114	600444	国机通用	1,500	19,470.00	0.03
115	688618	三旺通信	626	19,262.02	0.03
116	002250	联化科技	1,400	19,138.00	0.03
117	301027	华蓝集团	900	18,621.00	0.03
118	300725	药石科技	500	18,300.00	0.03
119	688552	航天南湖	646	18,171.98	0.03
120	002897	意华股份	200	17,596.00	0.03
121	300872	天阳科技	1,100	17,380.00	0.03
122	300456	赛微电子	400	16,988.00	0.03
123	301317	鑫磊股份	300	16,836.00	0.03
124	301193	家联科技	900	16,686.00	0.03
125	605003	众望布艺	800	16,400.00	0.03
126	300083	创世纪	1,200	16,344.00	0.03
127	001267	汇绿生态	300	16,050.00	0.03
128	600641	先导基电	400	15,944.00	0.03
129	300735	光弘科技	700	15,918.00	0.03
130	002144	宏达高科	1,600	15,760.00	0.03
131	300602	飞荣达	300	15,360.00	0.02
132	301192	泰祥股份	800	15,120.00	0.02
133	600556	天下秀	3,300	14,586.00	0.02
134	688613	奥精医疗	1,029	14,519.19	0.02
135	600795	国电电力	3,100	14,477.00	0.02
136	688391	钜泉科技	403	14,455.61	0.02
137	600774	汉商集团	2,300	14,398.00	0.02
138	301291	明阳电气	400	14,396.00	0.02
139	603009	北特科技	300	14,391.00	0.02
140	002993	奥海科技	200	14,322.00	0.02
141	301413	安培龙	200	14,176.00	0.02
142	300634	彩讯股份	700	13,699.00	0.02
143	002998	优彩资源	2,100	13,671.00	0.02
144	300809	华辰装备	500	13,525.00	0.02
145	600105	永鼎股份	200	13,496.00	0.02
146	601003	柳钢股份	3,900	13,143.00	0.02
147	002949	华阳国际	1,300	12,857.00	0.02
148	600158	中体产业	1,900	12,806.00	0.02
149	000738	航发控制	700	12,803.00	0.02
150	688486	龙迅股份	200	12,716.00	0.02
151	301109	军信股份	1,000	12,460.00	0.02
152	301106	骏成科技	600	12,444.00	0.02
153	001203	大中矿业	400	11,980.00	0.02
154	688355	明志科技	620	11,935.00	0.02
155	002887	绿茵生态	1,100	11,517.00	0.02
156	301196	唯科科技	90	11,287.80	0.02

157	300118	东方日升	900	11,205.00	0.02
158	600986	浙文互联	1,600	11,168.00	0.02
159	300017	网宿科技	800	10,408.00	0.02
160	300811	铂科新材	100	9,489.00	0.02
161	000628	高新发展	200	9,480.00	0.02
162	600266	城建发展	2,400	9,384.00	0.02
163	300593	新雷能	300	9,018.00	0.01
164	301055	张小泉	200	8,494.00	0.01

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	688238	和元生物	1,075,839.35	1.51
2	603703	盛洋科技	1,055,759.00	1.48
3	300129	泰胜风能	1,047,037.00	1.47
4	600785	新华百货	952,210.00	1.33
5	688207	格灵深瞳	925,876.70	1.30
6	300055	万邦达	910,273.00	1.27
7	688510	航亚科技	904,379.87	1.27
8	002522	浙江众成	889,164.00	1.24
9	300806	斯迪克	863,794.00	1.21
10	601388	怡球资源	842,052.00	1.18
11	600397	江钨装备	810,398.00	1.13
12	000949	新乡化纤	807,568.00	1.13
13	600067	冠城新材	795,437.00	1.11
14	605289	罗曼股份	786,616.20	1.10
15	688365	光云科技	773,056.30	1.08
16	600708	光明地产	771,823.00	1.08
17	688768	容知日新	763,281.59	1.07
18	002803	吉宏股份	761,568.00	1.07
19	600724	宁波富达	746,782.00	1.05
20	002454	松芝股份	742,158.00	1.04

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	688238	和元生物	1,232,518.24	1.72
2	300806	斯迪克	1,212,720.00	1.70
3	002522	浙江众成	1,163,037.00	1.63
4	600785	新华百货	1,048,958.00	1.47
5	600300	维维股份	1,013,067.00	1.42
6	600397	江钨装备	1,008,738.00	1.41

7	600724	宁波富达	1, 003, 381. 00	1. 40
8	688049	炬芯科技	965, 769. 57	1. 35
9	688207	格灵深瞳	956, 025. 73	1. 34
10	688531	日联科技	951, 003. 15	1. 33
11	000850	华茂股份	936, 113. 00	1. 31
12	605289	罗曼股份	927, 675. 00	1. 30
13	300241	瑞丰光电	921, 600. 00	1. 29
14	688233	神工股份	911, 093. 87	1. 28
15	300440	运达科技	909, 047. 00	1. 27
16	002392	北京利尔	900, 419. 00	1. 26
17	300032	金龙机电	886, 304. 00	1. 24
18	603012	创力集团	864, 520. 00	1. 21
19	300055	万邦达	862, 354. 00	1. 21
20	603703	盛洋科技	849, 900. 00	1. 19

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	362, 561, 498. 21
卖出股票收入（成交）总额	368, 782, 210. 95

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金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	69,764.57
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	69,764.57

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

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 (%)
782	44,069.96	20,998,206.00	60.93	13,464,499.00	39.07

8.2 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。

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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 12 月 1 日）基金份额总额	223,462,705.00
本报告期期初基金份额总额	43,462,705.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	34,462,705.00

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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(%)	
中信证券	7	731,343,709.16	100.00	106,415.18	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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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
2	《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
3	《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	2026 年 2 月 13 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 变更场内简称、扩位简称的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2026 年 2 月 13 日
5	《银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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	2026 年 4 月 15 日
8	《银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 4 月 21 日
10	《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	2026 年 6 月 5 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

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	20260101-20260630	17,800,000.00	0.00	7,370,000.00	10,430,000.00	30.26
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。							

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 2000 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

12.1.2 《银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《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合同》

12.1.4 《银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数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