

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

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 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，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 2025 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 2025 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
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	36
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	800 增强 ETF
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	14,742,624.00 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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(2025年1月1日 - 2025年6月30日)
本期已实现收益	155,793.44
本期利润	245,183.98
加权平均基金份额本期利润	0.0166
本期加权平均净值利润率	1.56%
本期基金份额净值增长率	1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	1,430,687.33
期末可供分配基金份额利润	0.0970
期末基金资产净值	16,173,311.33
期末基金份额净值	1.0970
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.70%

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。

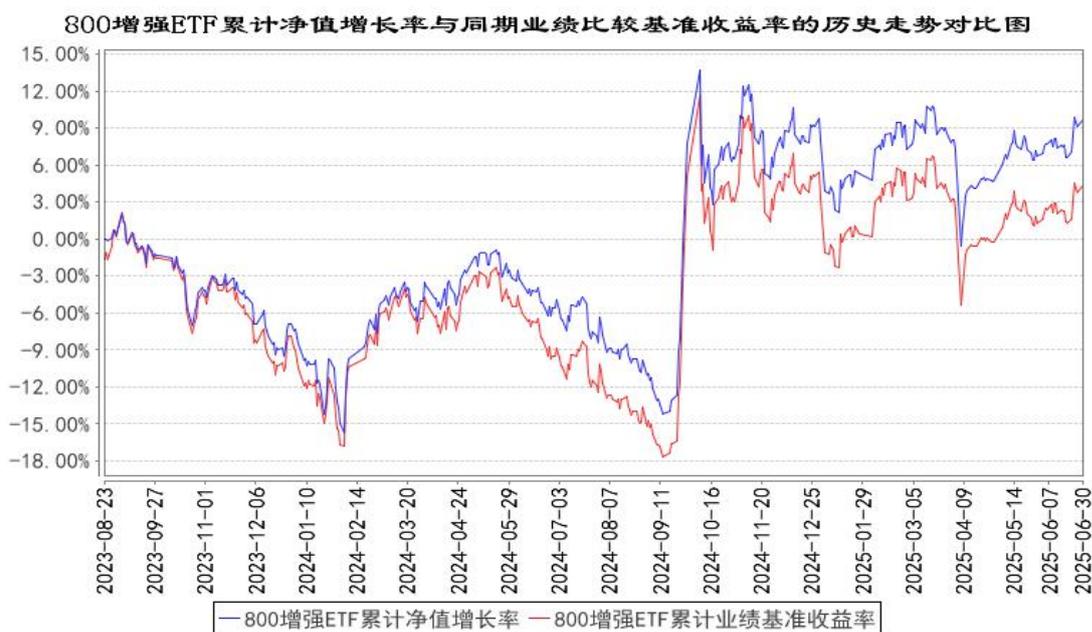
3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	2.78%	0.57%	2.96%	0.62%	-0.18%	-0.05%
过去三个月	1.74%	1.12%	1.18%	1.18%	0.56%	-0.06%
过去六个月	1.54%	1.00%	0.87%	1.09%	0.67%	-0.09%
过去一年	16.23%	1.33%	15.20%	1.45%	1.03%	-0.12%
自基金合同生效起至今	9.70%	1.13%	4.28%	1.24%	5.42%	-0.11%

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



注：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。

§ 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 年上半年，银华基金管理公募基金 227 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		
王帅先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 日	-	12.5 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>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 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。具有从业资格。国籍：中国。</p>
张凯先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 日	-	15.5 年	<p>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、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</p>

				<p>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</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					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。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	-	11 年	学士学位。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，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，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 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

2025 年上半年，国内外宏观经济运行呈现出一些新的特点。国内方面，整体经济格局依然延续弱复苏的态势。在消费品国补等政策支撑下，内需消费稳健。此外，上半年经济中出现了一些新的亮点，如 AI、传媒、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品。海外方面，关税战给全球贸易带来了明显的不确定性，全球风险偏好在上半年出现了较大幅度的波动，避险情绪上升。在上述因素的作用下，上半年 A 股市场呈现波动后修复的特征，上证指数、中证 500、创业板指等宽基指数获得正收益。

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 1.0970 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.54%，业绩比较基准收益率为 0.87%。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 2025 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、全球关税冲突、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 6 月 30 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 6 月 30 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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	691,803.86	654,598.26
结算备付金		35,688.13	72,882.75
存出保证金		1,655.56	2,617.11
交易性金融资产	6.4.7.2	15,466,413.05	15,233,491.73
其中：股票投资		15,466,413.05	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	825.00	880.00
资产总计		16,196,385.60	15,964,469.85
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		6,524.56	7,043.75
应付托管费		1,304.89	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	6.4.7.9	15,244.82	27,890.01
负债合计		23,074.27	36,342.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	14,742,624.00	14,742,624.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,430,687.33	1,185,503.35
净资产合计		16,173,311.33	15,928,127.35
负债和净资产总计		16,196,385.60	15,964,469.85

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0970 元，基金份额总额 14,742,624.00 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		291,997.58	-232,809.73
1. 利息收入		1,157.21	4,970.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,157.21	4,970.63
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）		201,449.83	98,528.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,198.82	-195,192.49
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	194,251.01	293,721.40

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	89, 390. 54	-337, 240. 34
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	-	931. 07
减：二、营业总支出		46, 813. 60	131, 910. 37
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	39, 010. 96	65, 206. 66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	7, 802. 11	13, 041. 38
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	0. 53	53, 662. 33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		245, 183. 98	-364, 720. 10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		245, 183. 98	-364, 720. 10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		245, 183. 98	-364, 720. 10

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	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“-”号填列)	-	-	245,183.98	245,183.98
(一)、综合收益总额	-	-	245,183.98	245,183.98
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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	-	1,430,687.33	16,173,311.33
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024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	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)	-15,000,000.00	-	1,324,386.74	-13,675,613.26

(一)、综合收益总额	-	-	-364,720.10	-364,720.10
(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)	-15,000,000.00	-	1,689,106.84	-13,310,893.16
其中：1. 基金申购款	72,000,000.00	-	-5,395,942.53	66,604,057.47
2. 基金赎回款	-87,000,000.00	-	7,085,049.37	-79,914,950.63
(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	23,742,624.00	-	-1,334,482.35	22,408,141.65

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 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。

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》、本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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年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[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》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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	691,803.86
等于：本金	691,742.41
加：应计利息	61.45
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	691,803.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,077,297.43	-	15,466,413.05	389,115.62
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		15,077,297.43	-	15,466,413.05	389,115.62

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	825.00
待摊费用	-
合计	825.00

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	4,370.50
其中：交易所市场	4,370.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	10,874.32
合计	15,244.82

6.4.7.10 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6月30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）	-	-
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	14,742,624.00	14,742,624.00

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	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	155,793.44	89,390.54	245,183.98
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,440,673.29	-9,985.96	1,430,687.33

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	1,076.70
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	75.21
其他	5.30
合计	1,157.21

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,198.82
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,198.82

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	29,541,039.57
减：卖出股票成本总额	29,506,677.13
减：交易费用	27,163.62
买卖股票差价收入	7,198.82

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	194,251.01
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	194,251.01

6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	89,390.54
股票投资	89,390.54
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	89,390.54

6.4.7.21 其他收入

注：无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	0.53
合计	0.53

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,010.96	65,206.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,886.65	2,709.10
应支付基金管理人的净管理费	35,124.31	62,497.56

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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,802.11	13,041.38

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：

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

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

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
招商银行	691,803.86	1,076.70	978,332.83	2,613.54

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2025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

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	691,803.86	-	-	-	691,803.86
结算备付金	35,688.13	-	-	-	35,688.13

存出保证金	1,655.56	-	-	-	1,655.56
交易性金融资产	-	-	-	15,466,413.05	15,466,413.05
其他资产	-	-	-	825.00	825.00
资产总计	729,147.55	-	-	15,467,238.05	16,196,385.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,524.56	6,524.56
应付托管费	-	-	-	1,304.89	1,304.89
其他负债	-	-	-	15,244.82	15,244.82
负债总计	-	-	-	23,074.27	23,074.27
利率敏感度缺口	729,147.55	-	-	15,444,163.78	16,173,311.33
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。

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 2025年6月30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	15,466,413.05	95.63	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	15,466,413.05	95.63	15,233,491.73	95.64

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	736,580.31	723,473.78
	业绩比较基准下降	-736,580.31	-723,473.78

	5%		
--	----	--	--

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	15,466,413.05	15,172,843.73
第二层次	-	60,648.00
第三层次	-	-
合计	15,466,413.05	15,233,491.73

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	15,466,413.05	95.49
	其中：股票	15,466,413.05	95.49
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	727,491.99	4.49
8	其他各项资产	2,480.56	0.02
9	合计	16,196,385.60	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	58,128.00	0.36
B	采矿业	677,070.00	4.19
C	制造业	7,518,590.77	46.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	617,111.00	3.82
E	建筑业	371,729.00	2.30
F	批发和零售业	137,821.40	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	471,143.00	2.91
H	住宿和餐饮业	2,244.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	987,934.80	6.11
J	金融业	3,272,101.82	20.23
K	房地产业	73,862.00	0.46
L	租赁和商务服务	179,860.00	1.11

	业		
M	科学研究和技术服务业	159,118.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	1,232.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,038.00	0.04
Q	卫生和社会工作	52,721.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	38,787.00	0.24
S	综合	1,163.00	0.01
	合计	14,627,654.79	90.44

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	6,148.00	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	547,243.26	3.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,140.00	0.12
F	批发和零售业	98,650.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	32,971.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,243.00	0.69
J	金融业	2,968.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,970.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	12,897.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,528.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	838,758.26	5.19

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	600519	贵州茅台	400	563,808.00	3.49
2	300750	宁德时代	1,400	353,108.00	2.18
3	601398	工商银行	44,500	337,755.00	2.09
4	601328	交通银行	32,300	258,400.00	1.60
5	601318	中国平安	4,600	255,208.00	1.58
6	600900	长江电力	6,900	207,966.00	1.29
7	000725	京东方 A	50,600	201,894.00	1.25
8	002594	比亚迪	600	199,146.00	1.23
9	601899	紫金矿业	9,800	191,100.00	1.18
10	601288	农业银行	30,800	181,104.00	1.12
11	601668	中国建筑	31,200	180,024.00	1.11
12	688111	金山办公	628	175,871.40	1.09
13	600219	南山铝业	43,300	165,839.00	1.03
14	000858	五粮液	1,300	154,570.00	0.96
15	600919	江苏银行	12,000	143,280.00	0.89
16	000333	美的集团	1,900	137,180.00	0.85
17	002027	分众传媒	17,900	130,670.00	0.81
18	600276	恒瑞医药	2,500	129,750.00	0.80
19	601601	中国太保	3,400	127,534.00	0.79
20	601600	中国铝业	18,000	126,720.00	0.78
21	600958	东方证券	12,900	124,872.00	0.77
22	600028	中国石化	21,500	121,260.00	0.75
23	600016	民生银行	24,000	114,000.00	0.70
24	688008	澜起科技	1,293	106,026.00	0.66
25	000651	格力电器	2,300	103,316.00	0.64
26	601728	中国电信	13,100	101,525.00	0.63
27	601658	邮储银行	18,200	99,554.00	0.62
28	300059	东方财富	4,000	92,520.00	0.57
29	000100	TCL 科技	21,200	91,796.00	0.57
30	601166	兴业银行	3,900	91,026.00	0.56
31	600019	宝钢股份	13,800	90,942.00	0.56
32	300442	润泽科技	1,800	89,154.00	0.55
33	601857	中国石油	10,400	88,920.00	0.55
34	000166	申万宏源	17,000	85,340.00	0.53
35	601818	光大银行	19,800	82,170.00	0.51
36	000338	潍柴动力	5,300	81,514.00	0.50

37	300759	康龙化成	3,300	80,982.00	0.50
38	601138	工业富联	3,700	79,106.00	0.49
39	600941	中国移动	700	78,785.00	0.49
40	600372	中航机载	6,500	78,390.00	0.48
41	300395	菲利华	1,500	76,650.00	0.47
42	000425	徐工机械	9,800	76,146.00	0.47
43	600050	中国联通	13,600	72,624.00	0.45
44	600406	国电南瑞	3,200	71,712.00	0.44
45	601211	国泰海通	3,742	71,696.72	0.44
46	688981	中芯国际	810	71,417.70	0.44
47	601766	中国中车	10,100	71,104.00	0.44
48	601229	上海银行	6,500	68,965.00	0.43
49	600660	福耀玻璃	1,200	68,412.00	0.42
50	000568	泸州老窖	600	68,040.00	0.42
51	688041	海光信息	478	67,536.62	0.42
52	601881	中国银河	3,700	63,455.00	0.39
53	300017	网宿科技	5,900	63,248.00	0.39
54	603259	药明康德	900	62,595.00	0.39
55	601919	中远海控	4,100	61,664.00	0.38
56	601901	方正证券	7,700	60,907.00	0.38
57	600030	中信证券	2,200	60,764.00	0.38
58	601988	中国银行	10,700	60,134.00	0.37
59	600887	伊利股份	2,100	58,548.00	0.36
60	600690	海尔智家	2,300	56,994.00	0.35
61	605117	德业股份	1,056	55,608.96	0.34
62	002532	天山铝业	6,500	54,015.00	0.33
63	002352	顺丰控股	1,100	53,636.00	0.33
64	000001	平安银行	4,400	53,108.00	0.33
65	600809	山西汾酒	300	52,917.00	0.33
66	600011	华能国际	7,400	52,836.00	0.33
67	601111	中国国航	6,600	52,074.00	0.32
68	300124	汇川技术	800	51,656.00	0.32
69	600741	华域汽车	2,900	51,185.00	0.32
70	000538	云南白药	900	50,211.00	0.31
71	300274	阳光电源	740	50,149.80	0.31
72	002252	上海莱士	7,200	49,464.00	0.31
73	000063	中兴通讯	1,500	48,735.00	0.30
74	601555	东吴证券	5,500	48,125.00	0.30
75	000792	盐湖股份	2,800	47,824.00	0.30
76	600938	中国海油	1,800	46,998.00	0.29
77	601991	大唐发电	14,600	46,282.00	0.29
78	600795	国电电力	9,500	45,980.00	0.28
79	600115	中国东航	11,400	45,942.00	0.28

80	601066	中信建投	1,900	45,695.00	0.28
81	600905	三峡能源	10,700	45,582.00	0.28
82	600426	华鲁恒升	2,100	45,507.00	0.28
83	600989	宝丰能源	2,800	45,192.00	0.28
84	601012	隆基绿能	3,000	45,060.00	0.28
85	300760	迈瑞医疗	200	44,950.00	0.28
86	603341	龙旗科技	1,100	44,693.00	0.28
87	002371	北方华创	100	44,221.00	0.27
88	002142	宁波银行	1,600	43,776.00	0.27
89	600018	上港集团	7,400	42,254.00	0.26
90	601186	中国铁建	5,200	41,652.00	0.26
91	601628	中国人寿	1,000	41,190.00	0.25
92	600685	中船防务	1,500	40,785.00	0.25
93	002001	新和成	1,900	40,413.00	0.25
94	600926	杭州银行	2,400	40,368.00	0.25
95	603296	华勤技术	500	40,340.00	0.25
96	300136	信维通信	1,800	40,320.00	0.25
97	600029	南方航空	6,800	40,120.00	0.25
98	600436	片仔癀	200	40,002.00	0.25
99	002414	高德红外	3,900	39,975.00	0.25
100	002736	国信证券	3,400	39,168.00	0.24
101	603288	海天味业	1,000	38,910.00	0.24
102	000783	长江证券	5,600	38,808.00	0.24
103	300015	爱尔眼科	3,000	37,440.00	0.23
104	601088	中国神华	900	36,486.00	0.23
105	601100	恒立液压	500	36,000.00	0.22
106	601390	中国中铁	6,400	35,904.00	0.22
107	601939	建设银行	3,800	35,872.00	0.22
108	600704	物产中大	6,800	35,836.00	0.22
109	002223	鱼跃医疗	1,000	35,600.00	0.22
110	600760	中航沈飞	600	35,172.00	0.22
111	600027	华电国际	6,300	34,461.00	0.21
112	002714	牧原股份	800	33,608.00	0.21
113	688778	厦钨新能	600	33,552.00	0.21
114	600000	浦发银行	2,400	33,312.00	0.21
115	600008	首创环保	10,900	32,918.00	0.20
116	002304	洋河股份	500	32,275.00	0.20
117	002273	水晶光电	1,600	31,952.00	0.20
118	002050	三花智控	1,200	31,656.00	0.20
119	000938	紫光股份	1,300	31,187.00	0.19
120	300212	易华录	1,400	30,464.00	0.19
121	601607	上海医药	1,700	30,396.00	0.19
122	000032	深桑达 A	1,500	30,345.00	0.19

123	600183	生益科技	1,000	30,150.00	0.19
124	600196	复星医药	1,200	30,108.00	0.19
125	300408	三环集团	900	30,060.00	0.19
126	600062	华润双鹤	1,600	29,856.00	0.18
127	601985	中国核电	3,200	29,824.00	0.18
128	688385	复旦微电	600	29,562.00	0.18
129	688599	天合光能	1,996	29,001.88	0.18
130	600143	金发科技	2,800	28,868.00	0.18
131	601225	陕西煤业	1,500	28,860.00	0.18
132	002466	天齐锂业	900	28,836.00	0.18
133	600025	华能水电	3,000	28,650.00	0.18
134	603260	合盛硅业	600	28,440.00	0.18
135	300002	神州泰岳	2,400	28,320.00	0.18
136	600362	江西铜业	1,200	28,116.00	0.17
137	300628	亿联网络	800	27,808.00	0.17
138	601006	大秦铁路	4,200	27,720.00	0.17
139	600377	宁沪高速	1,800	27,612.00	0.17
140	300014	亿纬锂能	600	27,486.00	0.17
141	301236	软通动力	500	27,320.00	0.17
142	300033	同花顺	100	27,301.00	0.17
143	000999	华润三九	870	27,213.60	0.17
144	600038	中直股份	700	27,167.00	0.17
145	601216	君正集团	4,900	27,048.00	0.17
146	002262	恩华药业	1,300	27,014.00	0.17
147	601319	中国人保	3,100	27,001.00	0.17
148	300418	昆仑万维	800	26,904.00	0.17
149	601618	中国中冶	9,000	26,820.00	0.17
150	000878	云南铜业	2,100	26,712.00	0.17
151	000887	中鼎股份	1,500	26,385.00	0.16
152	000039	中集集团	3,300	25,938.00	0.16
153	600031	三一重工	1,400	25,130.00	0.16
154	002415	海康威视	900	24,957.00	0.15
155	601058	赛轮轮胎	1,900	24,928.00	0.15
156	601169	北京银行	3,600	24,588.00	0.15
157	600233	圆通速递	1,900	24,491.00	0.15
158	603993	洛阳钼业	2,900	24,418.00	0.15
159	000895	双汇发展	1,000	24,410.00	0.15
160	000021	深科技	1,300	24,362.00	0.15
161	600497	驰宏锌锗	4,600	24,334.00	0.15
162	002179	中航光电	600	24,216.00	0.15
163	601377	兴业证券	3,900	24,141.00	0.15
164	002203	海亮股份	2,300	23,736.00	0.15
165	688472	阿特斯	2,586	23,661.90	0.15

166	600584	长电科技	700	23,583.00	0.15
167	603369	今世缘	600	23,358.00	0.14
168	600329	达仁堂	700	23,352.00	0.14
169	003816	中国广核	6,400	23,296.00	0.14
170	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.14
171	600015	华夏银行	2,900	22,939.00	0.14
172	601698	中国卫通	1,100	22,517.00	0.14
173	600515	海南机场	6,300	22,302.00	0.14
174	002085	万丰奥威	1,400	22,246.00	0.14
175	603799	华友钴业	600	22,212.00	0.14
176	601916	浙商银行	6,400	21,696.00	0.13
177	601868	中国能建	9,700	21,631.00	0.13
178	601717	中创智领	1,300	21,606.00	0.13
179	002463	沪电股份	500	21,290.00	0.13
180	000703	恒逸石化	3,600	21,168.00	0.13
181	002065	东华软件	2,200	21,120.00	0.13
182	600061	国投资本	2,800	21,056.00	0.13
183	300999	金龙鱼	700	20,671.00	0.13
184	300024	机器人	1,200	20,616.00	0.13
185	300207	欣旺达	1,000	20,060.00	0.12
186	300383	光环新网	1,400	20,020.00	0.12
187	600118	中国卫星	700	19,999.00	0.12
188	603737	三棵树	540	19,899.00	0.12
189	601788	光大证券	1,100	19,778.00	0.12
190	601009	南京银行	1,700	19,754.00	0.12
191	002138	顺络电子	700	19,684.00	0.12
192	601816	京沪高铁	3,400	19,550.00	0.12
193	603650	彤程新材	600	19,290.00	0.12
194	601162	天风证券	3,900	19,227.00	0.12
195	600295	鄂尔多斯	2,200	19,162.00	0.12
196	300699	光威复材	600	19,002.00	0.12
197	000876	新希望	2,000	18,760.00	0.12
198	600909	华安证券	3,200	18,656.00	0.12
199	600048	保利发展	2,300	18,630.00	0.12
200	688188	柏楚电子	140	18,432.40	0.11
201	002129	TCL 中环	2,400	18,432.00	0.11
202	002432	九安医疗	500	18,215.00	0.11
203	000728	国元证券	2,300	18,147.00	0.11
204	601838	成都银行	900	18,090.00	0.11
205	000513	丽珠集团	500	18,020.00	0.11
206	600863	内蒙华电	4,300	17,673.00	0.11
207	002311	海大集团	300	17,577.00	0.11
208	002517	恺英网络	900	17,379.00	0.11

209	002475	立讯精密	500	17,345.00	0.11
210	002916	深南电路	160	17,249.60	0.11
211	600977	中国电影	1,600	17,152.00	0.11
212	688361	中科飞测	200	16,838.00	0.10
213	600582	天地科技	2,800	16,772.00	0.10
214	601865	福莱特	1,100	16,731.00	0.10
215	688249	晶合集成	824	16,702.48	0.10
216	001979	招商蛇口	1,900	16,663.00	0.10
217	000301	东方盛虹	2,000	16,660.00	0.10
218	000415	渤海租赁	5,000	16,650.00	0.10
218	605589	圣泉集团	600	16,650.00	0.10
219	688120	华海清科	98	16,532.60	0.10
220	600901	江苏金租	2,700	16,362.00	0.10
221	601990	南京证券	2,000	16,160.00	0.10
222	601998	中信银行	1,900	16,150.00	0.10
223	000963	华东医药	400	16,144.00	0.10
224	000937	冀中能源	2,800	16,100.00	0.10
225	603345	安井食品	200	16,084.00	0.10
226	688220	翱捷科技	200	15,660.00	0.10
227	600535	天士力	1,000	15,650.00	0.10
228	300433	蓝思科技	700	15,610.00	0.10
229	300373	扬杰科技	300	15,570.00	0.10
230	300573	兴齐眼药	300	15,537.00	0.10
231	600529	山东药玻	700	15,498.00	0.10
232	002025	航天电器	300	15,423.00	0.10
233	600177	雅戈尔	2,100	15,330.00	0.09
234	688819	天能股份	552	15,323.52	0.09
235	603816	顾家家居	600	15,312.00	0.09
236	600585	海螺水泥	700	15,029.00	0.09
237	600873	梅花生物	1,400	14,966.00	0.09
238	600111	北方稀土	600	14,940.00	0.09
239	603885	吉祥航空	1,100	14,817.00	0.09
240	300474	景嘉微	200	14,600.00	0.09
241	002028	思源电气	200	14,582.00	0.09
242	601117	中国化学	1,900	14,573.00	0.09
243	002709	天赐材料	800	14,496.00	0.09
244	000050	深天马 A	1,700	14,484.00	0.09
245	603379	三美股份	300	14,436.00	0.09
246	600085	同仁堂	400	14,424.00	0.09
247	601872	招商轮船	2,300	14,398.00	0.09
248	000785	居然智家	4,700	14,335.00	0.09
249	002236	大华股份	900	14,292.00	0.09
250	601918	新集能源	2,200	14,212.00	0.09

251	688234	天岳先进	242	14,169.10	0.09
252	002056	横店东磁	1,000	14,150.00	0.09
253	000932	华菱钢铁	3,200	14,080.00	0.09
253	603019	中科曙光	200	14,080.00	0.09
254	688563	航材股份	247	13,987.61	0.09
255	600600	青岛啤酒	200	13,892.00	0.09
256	000960	锡业股份	900	13,770.00	0.09
257	603529	爱玛科技	400	13,760.00	0.09
258	000157	中联重科	1,900	13,737.00	0.08
259	601568	北元集团	3,300	13,695.00	0.08
260	300498	温氏股份	800	13,664.00	0.08
261	688180	君实生物	400	13,592.00	0.08
262	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.08
263	600309	万华化学	250	13,565.00	0.08
264	600299	安迪苏	1,400	13,510.00	0.08
265	601456	国联民生	1,300	13,455.00	0.08
266	688582	芯动联科	200	13,440.00	0.08
267	002044	美年健康	2,600	13,364.00	0.08
268	000630	铜陵有色	4,000	13,360.00	0.08
269	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.08
270	601665	齐鲁银行	2,100	13,272.00	0.08
271	601360	三六零	1,300	13,260.00	0.08
272	600380	健康元	1,200	13,236.00	0.08
273	600332	白云山	500	13,180.00	0.08
274	688425	铁建重工	3,215	13,117.20	0.08
275	000997	新大陆	400	12,952.00	0.08
276	002738	中矿资源	400	12,864.00	0.08
277	600998	九州通	2,500	12,850.00	0.08
278	603501	豪威集团	100	12,765.00	0.08
279	300502	新易盛	100	12,702.00	0.08
280	603986	兆易创新	100	12,653.00	0.08
281	600498	烽火通信	600	12,618.00	0.08
282	600079	人福医药	600	12,588.00	0.08
283	603195	公牛集团	260	12,545.00	0.08
284	000967	盈峰环境	1,800	12,510.00	0.08
285	601799	星宇股份	100	12,500.00	0.08
286	600985	淮北矿业	1,100	12,474.00	0.08
287	000738	航发控制	600	12,450.00	0.08
288	600959	江苏有线	3,600	12,384.00	0.08
289	603392	万泰生物	200	12,200.00	0.08
290	300601	康泰生物	800	12,152.00	0.08
291	001965	招商公路	1,000	12,000.00	0.07
292	600886	国投电力	800	11,792.00	0.07

293	002558	巨人网络	500	11,775.00	0.07
294	600875	东方电气	700	11,718.00	0.07
295	002831	裕同科技	500	11,710.00	0.07
296	300308	中际旭创	80	11,668.80	0.07
297	601179	中国西电	1,900	11,666.00	0.07
298	688538	和辉光电	4,938	11,554.92	0.07
299	600339	中油工程	3,500	11,445.00	0.07
300	300496	中科创达	200	11,444.00	0.07
301	600968	海油发展	2,800	11,424.00	0.07
302	600176	中国巨石	1,000	11,400.00	0.07
303	600808	马钢股份	3,300	11,385.00	0.07
304	600166	福田汽车	4,200	11,382.00	0.07
305	000975	山金国际	600	11,364.00	0.07
306	601598	中国外运	2,300	11,339.00	0.07
307	601877	正泰电器	500	11,335.00	0.07
308	002850	科达利	100	11,317.00	0.07
309	688469	芯联集成	2,358	11,247.66	0.07
310	601021	春秋航空	200	11,130.00	0.07
311	688375	国博电子	183	10,981.83	0.07
312	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.07
313	300803	指南针	135	10,889.10	0.07
314	601118	海南橡胶	2,300	10,856.00	0.07
315	688772	珠海冠宇	754	10,774.66	0.07
316	003031	中瓷电子	200	10,642.00	0.07
317	600566	济川药业	400	10,532.00	0.07
318	600637	东方明珠	1,400	10,458.00	0.06
319	002648	卫星化学	600	10,398.00	0.06
320	002841	视源股份	300	10,380.00	0.06
321	688122	西部超导	200	10,376.00	0.06
322	300765	新诺威	200	10,338.00	0.06
323	688183	生益电子	200	10,240.00	0.06
324	002920	德赛西威	100	10,213.00	0.06
325	000977	浪潮信息	200	10,176.00	0.06
326	688187	时代电气	238	10,150.70	0.06
327	002281	光迅科技	200	9,864.00	0.06
327	300919	中伟股份	300	9,864.00	0.06
328	601958	金钼股份	900	9,846.00	0.06
329	688223	晶科能源	1,889	9,803.91	0.06
330	000800	一汽解放	1,400	9,604.00	0.06
331	600547	山东黄金	300	9,579.00	0.06
332	600009	上海机场	300	9,531.00	0.06
333	002294	信立泰	200	9,466.00	0.06
334	300661	圣邦股份	130	9,460.10	0.06

335	600845	宝信软件	400	9,448.00	0.06
336	605499	东鹏饮料	30	9,421.50	0.06
337	301358	湖南裕能	300	9,357.00	0.06
338	002241	歌尔股份	400	9,328.00	0.06
339	600482	中国动力	400	9,228.00	0.06
340	600392	盛和资源	700	9,219.00	0.06
341	600820	隧道股份	1,500	9,150.00	0.06
342	002493	荣盛石化	1,100	9,108.00	0.06
343	688126	沪硅产业	481	9,004.32	0.06
344	000625	长安汽车	700	8,932.00	0.06
345	000009	中国宝安	1,000	8,880.00	0.05
346	301308	江波龙	100	8,749.00	0.05
347	300529	健帆生物	400	8,628.00	0.05
348	002653	海思科	200	8,444.00	0.05
349	600655	豫园股份	1,500	8,325.00	0.05
350	603605	珀莱雅	100	8,279.00	0.05
351	600056	中国医药	800	8,272.00	0.05
352	603858	步长制药	500	8,120.00	0.05
353	603000	人民网	400	8,084.00	0.05
354	002673	西部证券	1,000	7,880.00	0.05
355	603939	益丰药房	320	7,830.40	0.05
356	600862	中航高科	300	7,824.00	0.05
357	601928	凤凰传媒	700	7,819.00	0.05
358	002080	中材科技	400	7,800.00	0.05
358	601399	国机重装	2,600	7,800.00	0.05
359	600435	北方导航	500	7,795.00	0.05
360	002153	石基信息	900	7,794.00	0.05
361	601898	中煤能源	700	7,658.00	0.05
362	600487	亨通光电	500	7,650.00	0.05
363	600460	士兰微	300	7,446.00	0.05
364	600848	上海临港	800	7,256.00	0.04
365	000830	鲁西化工	700	7,210.00	0.04
366	002299	圣农发展	500	7,145.00	0.04
367	601995	中金公司	200	7,072.00	0.04
368	300037	新宙邦	200	7,040.00	0.04
369	002607	中公教育	2,300	7,038.00	0.04
370	600398	海澜之家	1,000	6,960.00	0.04
370	603589	口子窖	200	6,960.00	0.04
371	300751	迈为股份	100	6,956.00	0.04
372	000559	万向钱潮	900	6,885.00	0.04
373	000987	越秀资本	1,000	6,860.00	0.04
374	002958	青农商行	1,900	6,859.00	0.04
375	002739	万达电影	600	6,858.00	0.04

376	688561	奇安信	200	6,796.00	0.04
377	688676	金盘科技	200	6,690.00	0.04
378	600739	辽宁成大	600	6,600.00	0.04
379	601636	旗滨集团	1,300	6,513.00	0.04
380	002601	龙佰集团	400	6,484.00	0.04
381	600918	中泰证券	1,000	6,430.00	0.04
382	300115	长盈精密	300	6,420.00	0.04
383	002938	鹏鼎控股	200	6,406.00	0.04
384	002507	涪陵榨菜	500	6,395.00	0.04
385	002340	格林美	1,000	6,350.00	0.04
386	600415	小商品城	300	6,204.00	0.04
387	002261	拓维信息	200	6,190.00	0.04
388	301165	锐捷网络	100	6,146.00	0.04
389	601888	中国中免	100	6,097.00	0.04
390	600188	兖矿能源	500	6,085.00	0.04
391	002624	完美世界	400	6,068.00	0.04
392	300567	精测电子	100	6,061.00	0.04
393	600970	中材国际	700	6,006.00	0.04
394	601236	红塔证券	700	5,929.00	0.04
395	600801	华新水泥	500	5,920.00	0.04
396	300058	蓝色光标	900	5,904.00	0.04
397	601336	新华保险	100	5,850.00	0.04
398	300012	华测检测	500	5,845.00	0.04
399	603728	鸣志电器	100	5,747.00	0.04
400	300054	鼎龙股份	200	5,736.00	0.04
400	600160	巨化股份	200	5,736.00	0.04
401	000563	陕国投 A	1,600	5,712.00	0.04
402	600737	中粮糖业	600	5,670.00	0.04
403	002572	索菲亚	400	5,604.00	0.03
404	600132	重庆啤酒	100	5,510.00	0.03
405	000060	中金岭南	1,200	5,496.00	0.03
406	603087	甘李药业	100	5,478.00	0.03
407	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.03
408	600023	浙能电力	1,000	5,300.00	0.03
409	002966	苏州银行	600	5,268.00	0.03
410	600109	国金证券	600	5,262.00	0.03
411	000729	燕京啤酒	400	5,172.00	0.03
412	601989	中国重工	1,100	5,104.00	0.03
413	688349	三一重能	200	4,988.00	0.03
414	300676	华大基因	100	4,977.00	0.03
415	600988	赤峰黄金	200	4,976.00	0.03
416	600066	宇通客车	200	4,972.00	0.03
417	300450	先导智能	200	4,970.00	0.03

418	603233	大参林	300	4,890.00	0.03
419	000807	云铝股份	300	4,794.00	0.03
420	003022	联泓新科	300	4,749.00	0.03
421	688248	南网科技	150	4,719.00	0.03
422	000988	华工科技	100	4,701.00	0.03
423	300604	长川科技	100	4,491.00	0.03
424	600096	云天化	200	4,394.00	0.03
425	300073	当升科技	100	4,387.00	0.03
426	000617	中油资本	600	4,380.00	0.03
427	601997	贵阳银行	700	4,368.00	0.03
428	600346	恒力石化	300	4,278.00	0.03
429	000408	藏格矿业	100	4,267.00	0.03
430	002603	以岭药业	300	4,230.00	0.03
431	000739	普洛药业	300	4,200.00	0.03
432	000636	风华高科	300	4,122.00	0.03
433	600352	浙江龙盛	400	4,064.00	0.03
434	601577	长沙银行	400	3,976.00	0.02
435	002064	华峰化学	600	3,966.00	0.02
436	000591	太阳能	900	3,951.00	0.02
437	600956	新天绿能	500	3,860.00	0.02
438	600282	南钢股份	900	3,780.00	0.02
438	600803	新奥股份	200	3,780.00	0.02
439	002984	森麒麟	200	3,750.00	0.02
440	601611	中国核建	400	3,676.00	0.02
441	600578	京能电力	800	3,592.00	0.02
442	600089	特变电工	300	3,579.00	0.02
443	600663	陆家嘴	400	3,544.00	0.02
444	600546	山煤国际	400	3,492.00	0.02
445	300285	国瓷材料	200	3,470.00	0.02
446	600325	华发股份	700	3,409.00	0.02
447	000623	吉林敖东	200	3,390.00	0.02
448	000776	广发证券	200	3,362.00	0.02
449	600674	川投能源	200	3,208.00	0.02
450	002007	华兰生物	200	3,134.00	0.02
451	600885	宏发股份	140	3,123.40	0.02
452	600373	中文传媒	300	3,081.00	0.02
453	600517	国网英大	600	3,060.00	0.02
454	002185	华天科技	300	3,030.00	0.02
455	000893	亚钾国际	100	3,014.00	0.02
456	600995	南网储能	300	2,934.00	0.02
457	002608	江苏国信	400	2,932.00	0.02
458	601231	环旭电子	200	2,926.00	0.02
459	600511	国药股份	100	2,916.00	0.02

460	000750	国海证券	700	2,884.00	0.02
461	000683	博源化工	600	2,874.00	0.02
462	603565	中谷物流	300	2,865.00	0.02
463	601077	渝农商行	400	2,856.00	0.02
464	300003	乐普医疗	200	2,756.00	0.02
465	300316	晶盛机电	100	2,715.00	0.02
466	002152	广电运通	200	2,688.00	0.02
467	600925	苏能股份	500	2,615.00	0.02
468	300144	宋城演艺	300	2,565.00	0.02
469	000027	深圳能源	400	2,552.00	0.02
470	002444	巨星科技	100	2,551.00	0.02
471	002939	长城证券	300	2,514.00	0.02
472	601212	白银有色	800	2,504.00	0.02
473	600098	广州发展	400	2,500.00	0.02
474	000959	首钢股份	700	2,380.00	0.01
475	601061	中信金属	300	2,373.00	0.01
476	600580	卧龙电驱	120	2,372.40	0.01
477	300677	英科医疗	100	2,368.00	0.01
478	600720	中交设计	300	2,319.00	0.01
479	600754	锦江酒店	100	2,244.00	0.01
480	603707	健友股份	200	2,230.00	0.01
481	600583	海油工程	400	2,184.00	0.01
482	300413	芒果超媒	100	2,182.00	0.01
483	000598	兴蓉环境	300	2,163.00	0.01
484	600007	中国国贸	100	2,058.00	0.01
485	600348	华阳股份	300	1,998.00	0.01
486	600688	上海石化	700	1,995.00	0.01
487	300122	智飞生物	100	1,959.00	0.01
488	601669	中国电建	400	1,948.00	0.01
489	603927	中科软	100	1,934.00	0.01
490	301267	华夏眼科	100	1,917.00	0.01
491	600884	杉杉股份	200	1,892.00	0.01
492	300140	节能环境	300	1,851.00	0.01
493	601688	华泰证券	100	1,781.00	0.01
494	600131	国网信通	100	1,770.00	0.01
495	600999	招商证券	100	1,759.00	0.01
496	000723	美锦能源	400	1,728.00	0.01
497	600361	创新新材	400	1,596.00	0.01
498	600859	王府井	100	1,389.00	0.01
499	601098	中南传媒	100	1,312.00	0.01
500	600707	彩虹股份	200	1,292.00	0.01
501	601139	深圳燃气	200	1,272.00	0.01
502	002266	浙富控股	400	1,232.00	0.01

503	002423	中粮资本	100	1,223.00	0.01
504	002385	大北农	300	1,212.00	0.01
505	002500	山西证券	200	1,168.00	0.01
506	600673	东阳光	100	1,163.00	0.01
507	300146	汤臣倍健	100	1,124.00	0.01
508	600879	航天电子	100	1,047.00	0.01
509	002202	金风科技	100	1,025.00	0.01
510	601158	重庆水务	200	928.00	0.01
511	600021	上海电力	100	879.00	0.01

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	002149	西部材料	2,300	45,655.00	0.28
2	603997	继峰股份	2,700	35,208.00	0.22
3	300738	奥飞数据	1,500	31,395.00	0.19
4	603444	吉比特	100	30,195.00	0.19
5	001339	智微智能	600	28,998.00	0.18
6	600012	皖通高速	1,700	28,866.00	0.18
7	688362	甬矽电子	805	23,972.90	0.15
8	300602	飞荣达	1,100	23,331.00	0.14
9	002389	航天彩虹	900	23,040.00	0.14
10	600710	苏美达	2,300	22,103.00	0.14
11	603383	顶点软件	500	21,200.00	0.13
12	301376	致欧科技	1,100	20,075.00	0.12
13	688147	微导纳米	654	19,737.72	0.12
14	688088	虹软科技	392	18,914.00	0.12
15	002727	一心堂	1,100	17,974.00	0.11
16	688630	芯碁微装	200	15,874.00	0.10
17	002895	川恒股份	700	15,792.00	0.10
18	300009	安科生物	1,700	14,229.00	0.09
19	301363	美好医疗	800	14,112.00	0.09
20	688050	爱博医疗	200	13,770.00	0.09
21	688612	威迈斯	486	12,995.64	0.08
22	300416	苏试试验	900	12,897.00	0.08
23	600782	新钢股份	3,600	12,744.00	0.08
24	000928	中钢国际	2,000	12,560.00	0.08
25	002891	中宠股份	200	12,374.00	0.08
26	688300	联瑞新材	260	12,103.00	0.07
27	688192	迪哲医药	200	11,960.00	0.07
28	688333	铂力特	200	11,912.00	0.07
29	301035	润丰股份	200	11,868.00	0.07
30	002597	金禾实业	500	11,775.00	0.07
31	002541	鸿路钢构	700	11,718.00	0.07

32	688652	京仪装备	200	11,464.00	0.07
33	300657	弘信电子	400	11,156.00	0.07
34	002245	蔚蓝锂芯	700	8,981.00	0.06
35	002091	江苏国泰	1,200	8,724.00	0.05
36	601208	东材科技	900	8,532.00	0.05
37	600993	马应龙	300	8,484.00	0.05
38	600507	方大特钢	1,900	8,246.00	0.05
39	002706	良信股份	900	8,019.00	0.05
40	600976	健民集团	200	7,842.00	0.05
41	603456	九洲药业	500	7,605.00	0.05
42	000848	承德露露	800	7,304.00	0.05
43	600667	太极实业	1,000	6,580.00	0.04
44	300166	东方国信	600	6,540.00	0.04
45	605296	神农集团	200	6,148.00	0.04
46	002484	江海股份	300	6,147.00	0.04
47	300693	盛弘股份	200	5,992.00	0.04
48	300638	广和通	200	5,726.00	0.04
49	002020	京新药业	400	5,220.00	0.03
50	600866	星湖科技	700	4,837.00	0.03
51	300298	三诺生物	200	4,518.00	0.03
52	600216	浙江医药	300	4,437.00	0.03
53	600416	湘电股份	300	4,032.00	0.02
54	300770	新媒股份	100	3,999.00	0.02
55	688351	微电生理	200	3,940.00	0.02
56	300755	华致酒行	200	3,860.00	0.02
57	600664	哈药股份	1,000	3,680.00	0.02
58	002416	爱施德	300	3,606.00	0.02
59	000810	创维数字	300	3,534.00	0.02
60	603108	润达医疗	200	3,532.00	0.02
61	002690	美亚光电	200	3,374.00	0.02
62	301087	可孚医疗	100	3,320.00	0.02
63	002487	大金重工	100	3,290.00	0.02
64	605599	菜百股份	200	3,270.00	0.02
65	300049	福瑞股份	100	3,243.00	0.02
66	600933	爱柯迪	200	3,202.00	0.02
67	600269	赣粤高速	600	3,036.00	0.02
68	001323	慕思股份	100	3,016.00	0.02
69	600729	重庆百货	100	2,983.00	0.02
70	600643	爱建集团	400	2,968.00	0.02
71	601595	上海电影	100	2,964.00	0.02
72	002697	红旗连锁	500	2,675.00	0.02
73	300432	富临精工	200	2,614.00	0.02
74	002701	奥瑞金	400	2,380.00	0.01

75	000821	京山轻机	200	2,318.00	0.01
76	002396	星网锐捷	100	2,245.00	0.01
77	301015	百洋医药	100	2,006.00	0.01
78	600138	中青旅	200	1,970.00	0.01
79	300119	瑞普生物	100	1,942.00	0.01
80	601900	南方传媒	100	1,564.00	0.01
81	603766	隆鑫通用	100	1,276.00	0.01
82	000828	东莞控股	100	1,069.00	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	600519	贵州茅台	299,431.00	1.88
2	601328	交通银行	252,187.00	1.58
3	688111	金山办公	251,940.04	1.58
4	601899	紫金矿业	196,938.00	1.24
5	002594	比亚迪	174,002.00	1.09
6	601398	工商银行	164,942.00	1.04
7	600900	长江电力	150,087.00	0.94
8	601138	工业富联	146,694.00	0.92
9	000858	五粮液	145,788.00	0.92
10	600919	江苏银行	144,921.00	0.91
11	000568	泸州老窖	141,323.00	0.89
12	002475	立讯精密	137,783.00	0.87
13	600660	福耀玻璃	137,758.00	0.86
14	601211	国泰海通	136,283.96	0.86
15	688256	寒武纪	133,358.00	0.84
16	603259	药明康德	132,430.00	0.83
17	601166	兴业银行	132,336.00	0.83
18	000338	潍柴动力	132,050.00	0.83
19	300442	润泽科技	131,744.00	0.83
20	600655	豫园股份	127,276.00	0.80

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	688256	寒武纪	283,212.00	1.78
2	600887	伊利股份	208,170.00	1.31
3	601816	京沪高铁	197,887.00	1.24
4	601318	中国平安	186,338.00	1.17
5	601211	国泰海通	175,518.00	1.10
6	600406	国电南瑞	161,788.00	1.02

7	600183	生益科技	157,045.00	0.99
8	002050	三花智控	153,685.00	0.96
9	603259	药明康德	152,094.00	0.95
10	601899	紫金矿业	148,432.00	0.93
11	000651	格力电器	146,976.00	0.92
12	002236	大华股份	146,280.00	0.92
13	600519	贵州茅台	143,256.00	0.90
14	002415	海康威视	141,287.00	0.89
15	300433	蓝思科技	140,771.00	0.88
16	600346	恒力石化	139,771.00	0.88
17	000001	平安银行	139,024.00	0.87
18	000157	中联重科	133,690.00	0.84
19	600901	江苏金租	133,625.00	0.84
20	600050	中国联通	132,696.00	0.83

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	29,650,207.91
卖出股票收入（成交）总额	29,541,039.57

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,655.56
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	825.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,480.56

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 (%)
154	95,731.32	12,691,694.00	86.09	2,050,930.00	13.91

8.2 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	招商证券股份有限公司	4,350,865.00	29.51
2	东方证券股份有限公司	3,394,203.00	23.02
3	中兵财富资产管理有限责任公司—中兵资产白鹿1号平衡私募证券投资基金	2,090,900.00	14.18
4	广发证券股份有限公司	1,713,926.00	11.63
5	东方证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,139,900.00	7.73
6	金雪雁	944,073.00	6.40
7	赵美玉	299,521.00	2.03
8	许杰涛	130,300.00	0.88
9	李莹莹	50,002.00	0.34
9	刘芳美	50,002.00	0.34
9	张文葵	50,002.00	0.34

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。

8.3 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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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 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	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,742,624.00

§ 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

本基金管理人于 2025 年 4 月 26 日发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，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。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	49,156,748.18	83.18	7,173.52	83.18	-
中信建投	2	9,943,597.38	16.82	1,450.72	16.82	撤销2个交易单元
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	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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》	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 20 日
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	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2025 年 4 月 11 日

	商终止的公告》	网站, 证券时报	
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

§ 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	20250325-20250406	1,444,002.00	9,341,701.00	7,391,500.00	3,394,203.00	23.02
	1	20250508-20250508	1,444,002.00	9,341,701.00	7,391,500.00	3,394,203.00	23.02
	1	20250514-20250630	1,444,002.00	9,341,701.00	7,391,500.00	3,394,203.00	23.02
	2	20250416-20250505	1,357,026.00	10,103,200.00	9,746,300.00	1,713,926.00	11.63
	3	20250101-20250630	4,311,888.00	10,045,253.00	10,006,276.00	4,350,865.00	29.51

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 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

12.1.2 《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》

12.1.3 《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》

12.1.4 《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》

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

2025 年 8 月 29 日