

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
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2025 年 08 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	43

8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末上市基金前十名持有人	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	64
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	66
13.3 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
基金简称	科综指增
场内简称	科综指增（扩位简称：科创增强 ETF 银华）
基金主代码	588690
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 20 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	127,636,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 8 月 29 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，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.50%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>在建仓完成后，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	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、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。</p> <p>本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	帅芳
	联系电话	(010) 58163000	021-38677947

电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tgrxp@tg.gtth.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	021-38917599-5
传真	(010)58163027	021-50872603
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
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	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码	100738	200041
法定代表人	王珠林	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日） - 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	39,532,945.90
本期利润	41,682,532.14
加权平均基金份额本期利润	0.1199
本期加权平均净值利润率	11.77%
本期基金份额净值增长率	5.61%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	7,164,943.69
期末可供分配基金份额利润	0.0561
期末基金资产净值	134,800,943.69
期末基金份额净值	1.0561
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	5.61%

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。

4、本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，主要财务指标的计算期间为自 2025 年 08 月 20 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

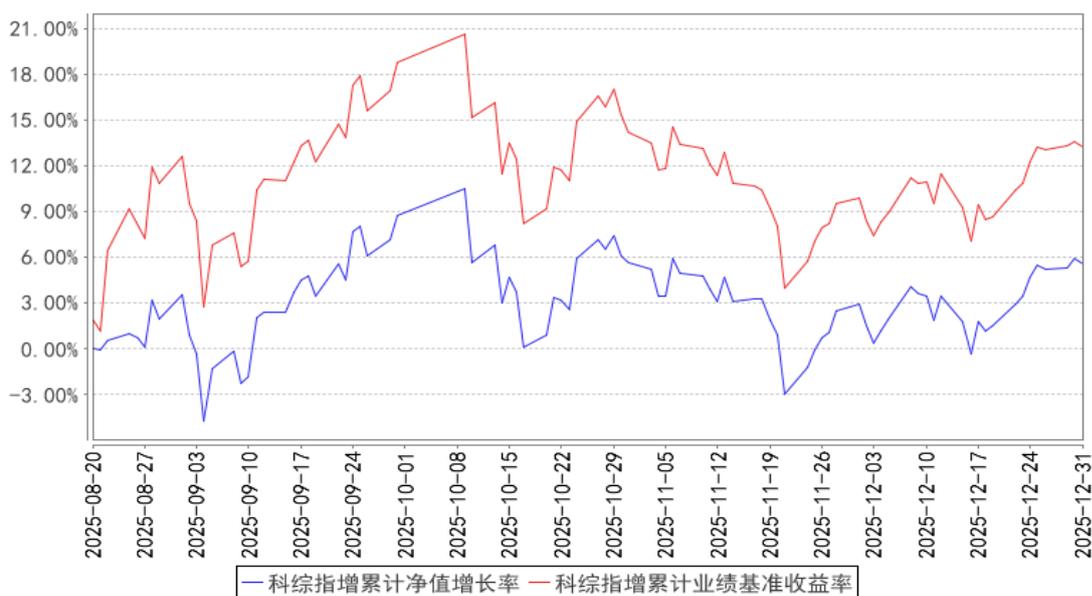
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.87%	1.56%	-4.68%	1.63%	1.81%	-0.07%
自基金合同生效起至今	5.61%	1.65%	13.21%	1.89%	-7.60%	-0.24%

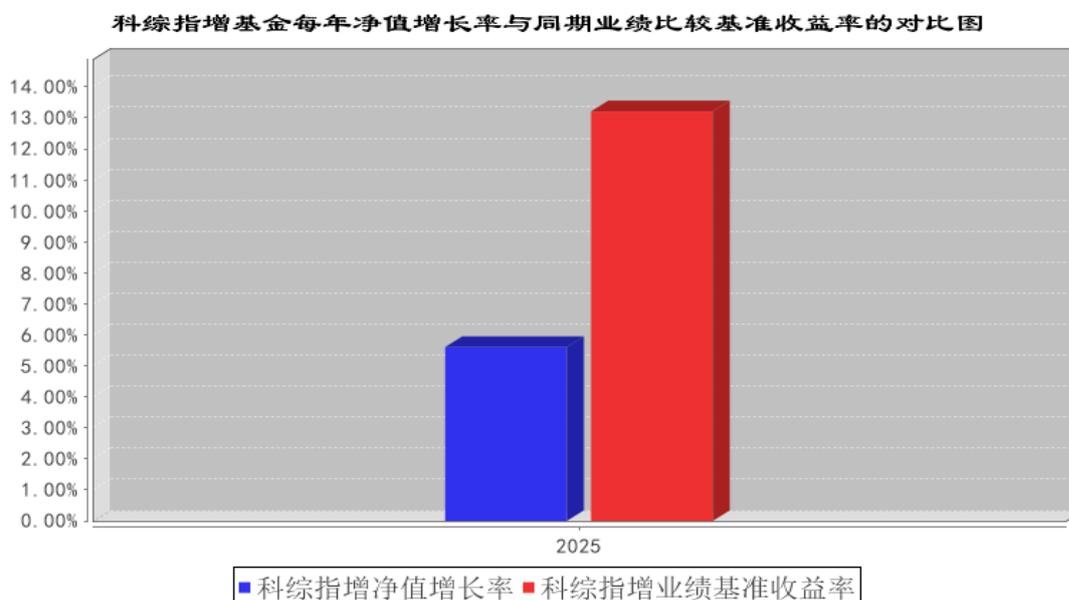
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

科综指增累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2025 年 08 月 20 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2025年08月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于2001年5月，注册资本2.222亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至2025年底，银华基金管理公募基金242只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自2020年起连续五年实现运营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目

追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2025年8月20日	-	16.5年	硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监/投资经理助理（社保、基本养老）/基金经理。自2012年11月14日至2020年11月25日担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2013年11月5日至2019年9月26日兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2016年4月7日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年4月25日至2018年11月30日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2020年11月29日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理，自2019年6月28日至2021年7月23日兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年8月29日至2020年12月31日兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2019年12月6日至2021年9月17日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年11月26日至2022年7月28日兼任银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2020年11月30日起兼任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年1月1日起兼任银华深证100指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年2月3日至2022年2月23日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年5月13日至2022年6月17日兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基

					金经理,自 2021 年 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2021 年 11 月 19 日至 2025 年 4 月 28 日兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2025 年 8 月 20 日起兼任银华上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2025 年 9 月 16 日起兼任银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理,自 2026 年 3 月 18 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
张卓希女士	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 22 日	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永(中国)企业咨询有限公司,2016 年 5 月加入银华基金,现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
郭九良先生	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理股份有限公司,现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
谭普景先生	本基金的基金经理	2025 年 8 月 20 日	2025 年 10 月 22	12 年	大学本科。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公

	助理		日		司。2013 年 7 月加入银华基金。现任量化投资部基金经理。自 2025 年 12 月 5 日起担任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,自 2026 年 2 月 10 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
--	----	--	---	--	---

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理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四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从 T 检验(置信度为 95%)和溢价率占优频率等方面

进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0561 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.61%，业绩比较基准收益率为 13.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的波动与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，国内政策、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实基于风险的反洗钱理念，健全反洗钱制度

建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2025 年 08 月 20 日至 2025 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z1123 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华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全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了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（以下简称“科综指增”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了科综指增 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于科综指增，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>科综指增的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估科综指增的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算科综指增、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督科综指增的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结</p>

	<p>论。同时，根据获取的审计证据，就可能对科综指增持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致科综指增不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹 陈玉珊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2026年03月26日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华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

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	2,713,484.86
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	132,464,952.92
其中：股票投资		132,464,952.92
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-

其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		135,178,437.78
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		252,404.55
应付赎回款		-
应付管理人报酬		65,200.19
应付托管费		13,040.03
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	46,849.32
负债合计		377,494.09
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	127,636,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	7,164,943.69
净资产合计		134,800,943.69
负债和净资产总计		135,178,437.78

注：1. 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0561 元，基金份额总额 127,636,000.00 份。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 08 月 20 日至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年8月20日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		42,532,063.88
1. 利息收入		128,770.54
其中：存款利息收入	7.4.7.13	128,770.54
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）		40,160,273.99
其中：股票投资收益	7.4.7.14	39,860,729.16
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	299,544.83
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.20	2,149,586.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	93,433.11
减：二、营业总支出		849,531.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	616,441.65
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	123,288.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	109,801.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		41,682,532.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,682,532.14
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		41,682,532.14

注：本基金合同生效日为2025年08月20日，无上年度可比期间数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,211,636,000.00	-	-	1,211,636,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,084,000,000.00	-	7,164,943.69	-1,076,835,056.31
（一）、综合收益总额	-	-	41,682,532.14	41,682,532.14
（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）	-1,084,000,000.00	-	-34,517,588.45	-1,118,517,588.45
其中：1. 基金申购款	40,000,000.00	-	297,124.07	40,297,124.07
2. 基金赎回款	-1,124,000,000.00	-	-34,814,712.52	-1,158,814,712.52
（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	127,636,000.00	-	7,164,943.69	134,800,943.69

注：本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]941 号《关于准予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 1,211,636,000.00 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]200Z0130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2025 年 8 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,211,636,000.00 份基金份额，未发生利息折份额的情况。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2025]199 号核准，本基金 1,211,636,000.00 份基金份额于 2025 年 8 月 29 日在上交所挂牌交易。

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合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。在建仓完成后，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。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(包含主板股票、创业板股票、科创板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、分离交易可转换公司

债券、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:上证科创板综合指数收益率。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华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合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 08 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 08 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 08 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交

易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。本基金在基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率时,可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
----	-------------------------

活期存款	160,020.17
等于：本金	159,951.75
加：应计利息	68.42
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	2,553,464.69
等于：本金	2,553,423.33
加：应计利息	41.36
减：坏账准备	-
合计	2,713,484.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	130,315,366.68	-	132,464,952.92	2,149,586.24
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	130,315,366.68	-	132,464,952.92	2,149,586.24

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	46,849.32
合计	46,849.32

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,211,636,000.00	1,211,636,000.00
本期申购	40,000,000.00	40,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,124,000,000.00	-1,124,000,000.00
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	127,636,000.00	127,636,000.00

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	39,532,945.90	2,149,586.24	41,682,532.14
本期基金份额交易产生的变动数	-26,157,092.07	-8,360,496.38	-34,517,588.45
其中：基金申购款	1,595,672.10	-1,298,548.03	297,124.07
基金赎回款	-27,752,764.17	-7,061,948.35	-34,814,712.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,375,853.83	-6,210,910.14	7,164,943.69

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	119,099.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9,670.87
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	128,770.54

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,787,922.01
股票投资收益——赎回差价收入	25,072,807.15
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	39,860,729.16

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	573,404,864.44
减：卖出股票成本总额	557,857,679.72
减：交易费用	759,262.71
买卖股票差价收入	14,787,922.01

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,158,814,712.52
减：现金支付赎回款总额	110,337,118.52
减：赎回股票成本总额	1,023,404,786.85
减：交易费用	-
赎回差价收入	25,072,807.15

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	299,544.83
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	299,544.83

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1. 交易性金融资产	2,149,586.24
股票投资	2,149,586.24
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	2,149,586.24

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	24,481.30
其他	68,951.81
合计	93,433.11

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	69,801.79
合计	109,801.79

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金托管人、基金代销机构
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	616,441.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	240,539.56
应支付基金管理人的净管理费	375,902.09

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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	123,288.30

注：支付基金托管人国泰海通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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
国泰海通	160,020.17	119,099.67

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰海通保管，存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位）	期末成本总额	期末估值总额	备注

							股)			
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股流通受限	46.68	55.66	52	2,427.36	2,894.32	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	141	2,408.28	6,846.96	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股流通受限	14.99	34.87	315	4,721.85	10,984.05	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股流通受限	26.68	42.25	141	3,761.88	5,957.25	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板、创业板股份，在受让后6个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年1月5日	278.00	9,151	2,215,236.83	2,495,660.72	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,713,484.86	-	-	-	2,713,484.86
交易性金融资产	-	-	-	132,464,952.92	132,464,952.92
资产总计	2,713,484.86	-	-	132,464,952.92	135,178,437.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	65,200.19	65,200.19

应付托管费	-	-	-	13,040.03	13,040.03
应付清算款	-	-	-	252,404.55	252,404.55
其他负债	-	-	-	46,849.32	46,849.32
负债总计	-	-	-	377,494.09	377,494.09
利率敏感度缺口	2,713,484.86	-	-	-132,087,458.83	134,800,943.69

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	132,464,952.92	98.27
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	132,464,952.92	98.27
----	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,516,271.67
	业绩比较基准下降 5%	-5,516,271.67

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	129,936,169.34
第二层次	2,495,660.72
第三层次	33,122.86

合计	132,464,952.92
----	----------------

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月20日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	-	-
当期购买	0.00	-	-
当期出售/结算	0.00	-	-
转入第三层次	0.00	16,016.35	16,016.35
转出第三层次	0.00	-	-
当期利得或损失总额	0.00	17,106.51	17,106.51
其中：计入损益的利得或损失	0.00	17,106.51	17,106.51
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	-	-
期末余额	0.00	33,122.86	33,122.86
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	17,106.51	17,106.51

注：于2025年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金购买第三层次交易性金融资产及第三层次转入/转出的交易性金融资产均为限售股票投资及限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	33,122.86	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	82.85%-303.23%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	132,464,952.92	97.99
	其中：股票	132,464,952.92	97.99
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	2,713,484.86	2.01
8	其他各项资产	-	-
9	合计	135,178,437.78	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,084,199.86	72.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,714,917.83	20.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,106,621.07	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	313,931.30	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	127,219,670.06	94.38

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	389,591.00	0.29
C	制造业	3,367,986.61	2.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	382,033.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	546,878.00	0.41
J	金融业	108,946.00	0.08
K	房地产业	60,420.00	0.04
L	租赁和商务服务业	256,575.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	132,853.25	0.10
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,245,282.86	3.89

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	6,326	8,575,209.30	6.36
2	688041	海光信息	36,758	8,248,862.78	6.12
3	688981	中芯国际	31,884	3,916,311.72	2.91
4	688012	中微公司	9,151	2,495,660.72	1.85
5	688008	澜起科技	20,413	2,404,651.40	1.78
6	688111	金山办公	6,758	2,075,179.06	1.54
7	688506	百利天恒	4,487	1,449,749.70	1.08
8	688578	艾力斯	12,627	1,315,102.05	0.98
9	688778	厦钨新能	16,197	1,253,161.89	0.93
10	688002	睿创微纳	12,346	1,244,476.80	0.92
11	688099	晶晨股份	13,914	1,213,718.22	0.90
12	688521	芯原股份	8,582	1,175,476.54	0.87
13	688472	阿特斯	72,342	1,078,619.22	0.80
14	688469	芯联集成	160,788	1,075,671.72	0.80
15	688271	联影医疗	8,481	1,064,365.50	0.79
16	689009	九号公司	19,038	1,058,322.42	0.79
17	688183	生益电子	10,597	1,014,026.93	0.75

18	688278	特宝生物	12,006	1,004,662.08	0.75
19	688072	拓荆科技	2,959	976,470.00	0.72
20	688120	华海清科	6,478	972,218.24	0.72
21	688629	华丰科技	9,641	964,678.46	0.72
22	688702	盛科通信	6,663	944,080.47	0.70
23	688213	思特威	9,756	927,698.04	0.69
24	688279	峰昭科技	4,503	916,315.47	0.68
25	688322	奥比中光	10,162	911,226.54	0.68
26	688617	惠泰医疗	3,640	885,502.80	0.66
27	688200	华峰测控	4,597	874,349.40	0.65
28	688018	乐鑫科技	5,023	853,910.00	0.63
29	688088	虹软科技	17,190	850,905.00	0.63
30	688347	华虹公司	7,813	842,788.31	0.63
31	688249	晶合集成	25,104	833,201.76	0.62
32	688126	沪硅产业	38,406	831,105.84	0.62
33	688772	珠海冠宇	37,421	805,674.13	0.60
34	688819	天能股份	23,839	791,931.58	0.59
35	688380	中微半导	23,285	748,612.75	0.56
36	688009	中国通号	136,672	747,595.84	0.55
37	688036	传音控股	11,264	745,226.24	0.55
38	688017	绿的谐波	3,712	713,075.20	0.53
39	688612	威迈斯	21,202	699,029.94	0.52
40	688336	三生国健	11,687	696,194.59	0.52
41	688220	翱捷科技	8,416	695,245.76	0.52
42	688636	智明达	14,952	640,543.68	0.48
43	688385	复旦微电	8,570	631,609.00	0.47
44	688027	国盾量子	1,236	622,684.44	0.46
45	688216	气派科技	27,625	615,485.00	0.46
46	688248	南网科技	13,365	597,950.10	0.44
47	688116	天奈科技	12,090	570,043.50	0.42
48	688067	爱威科技	23,134	568,171.04	0.42
49	688681	科汇股份	32,138	564,986.04	0.42
50	688082	盛美上海	3,193	562,127.65	0.42
51	688439	振华风光	8,694	561,632.40	0.42
52	688591	泰凌微	13,168	560,430.08	0.42
53	688708	佳驰科技	8,962	557,884.50	0.41
54	688329	艾隆科技	26,087	555,392.23	0.41
55	688021	奥福科技	30,106	552,445.10	0.41
56	688499	利元亨	9,504	548,570.88	0.41
57	688129	东来技术	26,679	539,716.17	0.40
58	688375	国博电子	5,793	539,386.23	0.40
59	688127	蓝特光学	13,912	535,472.88	0.40
60	688449	联芸科技	11,828	534,389.04	0.40

61	688280	精进电动	61,349	533,736.30	0.40
62	688528	秦川物联	49,483	532,931.91	0.40
63	688582	芯动联科	8,009	529,474.99	0.39
64	688668	鼎通科技	4,159	515,716.00	0.38
65	688726	拉普拉斯	14,293	514,548.00	0.38
66	688187	时代电气	9,835	504,437.15	0.37
67	688615	合合信息	2,184	497,034.72	0.37
68	688153	唯捷创芯	13,001	489,357.64	0.36
69	688608	恒玄科技	2,151	488,147.94	0.36
70	688321	微芯生物	16,505	482,276.10	0.36
71	688063	派能科技	8,375	475,867.50	0.35
72	688798	艾为电子	6,160	468,837.60	0.35
73	688383	新益昌	5,977	467,819.79	0.35
74	688091	上海谊众	9,760	458,720.00	0.34
75	688563	航材股份	7,828	457,546.60	0.34
76	688630	芯碁微装	3,342	449,599.26	0.33
77	688371	菲沃泰	24,176	446,530.72	0.33
78	688425	铁建重工	88,068	446,504.76	0.33
79	688209	英集芯	22,353	445,718.82	0.33
80	688235	百济神州	1,623	435,937.80	0.32
81	688588	凌志软件	29,862	427,325.22	0.32
82	688118	普元信息	16,584	423,223.68	0.31
83	688396	华润微	7,889	417,012.54	0.31
84	688047	龙芯中科	3,129	413,372.19	0.31
85	688395	正弦电气	16,775	407,968.00	0.30
86	688571	杭华股份	54,655	407,179.75	0.30
87	688070	纵横股份	7,334	406,303.60	0.30
88	688517	金冠电气	25,840	402,845.60	0.30
89	688435	英方软件	8,541	399,462.57	0.30
90	688060	云涌科技	9,383	397,182.39	0.29
91	688188	柏楚电子	2,913	395,847.57	0.29
92	688288	鸿泉技术	14,760	395,715.60	0.29
93	688779	五矿新能	52,286	391,622.14	0.29
94	688700	东威科技	10,932	385,680.96	0.29
95	688052	纳芯微	2,432	384,693.76	0.29
96	688475	萤石网络	12,757	384,113.27	0.28
97	688208	道通科技	10,436	384,044.80	0.28
98	688455	科捷智能	18,999	381,689.91	0.28
99	688686	奥普特	3,071	381,203.23	0.28
100	688022	瀚川智能	24,710	378,063.00	0.28
101	688259	创耀科技	9,015	376,827.00	0.28
102	688223	晶科能源	66,797	376,735.08	0.28
103	688159	有方科技	7,637	369,172.58	0.27

104	688789	宏华数科	4,495	366,657.15	0.27
105	688343	云天励飞	4,809	365,868.72	0.27
106	688372	伟测科技	3,345	364,906.05	0.27
107	688148	芳源股份	41,571	364,577.67	0.27
108	688538	和辉光电	134,143	356,820.38	0.26
109	688689	银河微电	12,563	356,537.94	0.26
110	688361	中科飞测	2,315	354,171.85	0.26
111	688530	欧莱新材	21,397	351,766.68	0.26
112	688030	山石网科	19,256	349,881.52	0.26
113	688096	京源环保	42,856	338,562.40	0.25
114	688609	九联科技	33,144	338,400.24	0.25
115	688548	广钢气体	23,260	338,200.40	0.25
116	688303	大全能源	12,445	333,774.90	0.25
117	688286	敏芯股份	4,163	328,668.85	0.24
118	688458	美芯晟	8,280	328,219.20	0.24
119	688019	安集科技	1,500	326,880.00	0.24
120	688026	洁特生物	19,952	321,426.72	0.24
121	688095	福昕软件	3,581	319,675.87	0.24
122	688365	光云科技	18,682	315,165.34	0.23
123	688045	必易微	7,922	306,502.18	0.23
124	688709	成都华微	6,519	299,808.81	0.22
125	688190	云路股份	3,061	298,141.40	0.22
126	688799	华纳药厂	6,217	296,550.90	0.22
127	688309	恒誉环保	12,256	295,737.28	0.22
128	688661	和林微纳	5,690	294,514.40	0.22
129	688038	中科通达	16,145	285,282.15	0.21
130	688352	颀中科技	22,456	283,170.16	0.21
131	688677	海泰新光	6,484	279,849.44	0.21
132	688166	博瑞医药	5,693	279,298.58	0.21
133	688160	步科股份	1,817	277,092.50	0.21
134	688122	西部超导	3,714	276,990.12	0.21
135	688312	燕麦科技	8,325	276,223.50	0.20
136	688123	聚辰股份	2,152	270,248.16	0.20
137	688638	誉辰智能	7,366	267,606.78	0.20
138	688296	和达科技	19,613	259,872.25	0.19
139	688718	唯赛勃	19,854	259,690.32	0.19
140	688320	禾川科技	6,860	256,015.20	0.19
141	688345	博力威	8,156	254,467.20	0.19
142	688003	天准科技	4,308	253,741.20	0.19
143	688631	莱斯信息	3,681	250,602.48	0.19
144	688237	超卓航科	5,137	250,428.75	0.19
145	688170	德龙激光	7,930	249,477.80	0.19
146	688257	新锐股份	7,225	247,673.00	0.18

147	688510	航亚科技	9,166	246,565.40	0.18
148	688079	美迪凯	21,258	240,640.56	0.18
149	688377	迪威尔	6,437	236,237.90	0.18
150	688567	孚能科技	15,064	235,751.60	0.17
151	688001	华兴源创	7,379	222,698.22	0.17
152	688429	时创能源	16,935	221,679.15	0.16
153	688297	中无人机	4,607	221,228.14	0.16
154	688222	成都先导	9,407	220,594.15	0.16
155	688207	格灵深瞳	14,484	220,156.80	0.16
156	688318	财富趋势	1,659	219,518.88	0.16
157	688523	航天环宇	3,865	216,285.40	0.16
158	688103	国力电子	3,535	214,185.65	0.16
159	688107	安路科技	7,859	213,607.62	0.16
160	688114	华大智造	3,508	213,146.08	0.16
161	688258	卓易信息	2,776	212,558.32	0.16
162	688167	炬光科技	1,208	211,484.56	0.16
163	688138	清溢光电	7,455	209,932.80	0.16
164	688516	奥特维	4,612	208,739.12	0.15
165	688262	国芯科技	6,865	208,352.75	0.15
166	688518	联赢激光	8,571	208,189.59	0.15
167	688595	芯海科技	6,267	205,557.60	0.15
168	688358	祥生医疗	6,766	203,656.60	0.15
169	688639	华恒生物	6,106	198,933.48	0.15
170	688369	致远互联	7,722	196,370.46	0.15
171	688775	影石创新	829	194,732.10	0.14
172	688277	天智航	12,770	193,976.30	0.14
173	688698	伟创电气	1,949	192,717.12	0.14
174	688556	高测股份	16,621	189,811.82	0.14
175	688311	盟升电子	4,132	188,419.20	0.14
176	688078	龙软科技	6,818	187,495.00	0.14
177	688061	灿瑞科技	5,734	186,985.74	0.14
178	688536	思瑞浦	1,159	185,300.92	0.14
179	688512	慧智微	16,551	184,709.16	0.14
180	688515	裕太微	1,797	184,282.35	0.14
181	688598	金博股份	6,227	182,824.72	0.14
182	688653	康希通信	14,736	179,042.40	0.13
183	688533	上声电子	6,121	178,978.04	0.13
184	688100	威胜信息	4,541	178,461.30	0.13
185	688507	索辰科技	1,770	177,513.30	0.13
186	688146	中船特气	4,349	175,699.60	0.13
187	688080	映翰通	3,477	175,588.50	0.13
188	688133	泰坦科技	7,908	175,083.12	0.13
189	688175	高凌信息	5,357	172,548.97	0.13

190	688687	凯因科技	6,914	172,296.88	0.13
191	688141	杰华特	3,927	170,549.61	0.13
192	688728	格科微	11,390	170,166.60	0.13
193	688410	山外山	11,303	169,205.91	0.13
194	688089	嘉必优	7,266	169,152.48	0.13
195	688301	奕瑞科技	1,648	166,629.28	0.12
196	688800	瑞可达	1,989	165,087.00	0.12
197	688198	佰仁医疗	1,522	162,869.22	0.12
198	688131	皓元医药	2,252	162,324.16	0.12
199	688025	杰普特	1,133	160,398.81	0.12
200	688011	新光光电	2,483	158,514.72	0.12
201	688201	信安世纪	10,834	158,501.42	0.12
202	688611	杭州柯林	3,105	157,889.25	0.12
203	688618	三旺通信	5,922	157,880.52	0.12
204	688023	安恒信息	3,058	157,211.78	0.12
205	688522	纳睿雷达	3,930	156,924.90	0.12
206	688128	中国电研	5,379	156,421.32	0.12
207	688196	卓越新能	2,609	153,670.10	0.11
208	688690	纳微科技	5,950	153,569.50	0.11
209	688180	君实生物	4,437	151,567.92	0.11
210	688193	仁度生物	3,127	151,252.99	0.11
211	688399	硕世生物	2,205	151,042.50	0.11
212	688101	三达膜	9,186	151,017.84	0.11
213	688283	坤恒顺维	3,739	150,681.70	0.11
214	688191	智洋创新	4,663	150,055.34	0.11
215	688418	震有科技	3,389	147,353.72	0.11
216	688172	燕东微	5,074	146,841.56	0.11
217	688678	福立旺	6,071	146,796.78	0.11
218	688168	安博通	1,915	143,931.40	0.11
219	688098	申联生物	16,089	142,870.32	0.11
220	688173	希荻微	9,697	142,545.90	0.11
221	688508	芯朋微	2,326	141,653.40	0.11
222	688251	井松智能	4,800	141,120.00	0.10
223	688231	隆达股份	5,387	140,062.00	0.10
224	688381	帝奥微	6,123	139,665.63	0.10
225	688360	德马科技	6,569	139,656.94	0.10
226	688722	同益中	7,139	139,567.45	0.10
227	688013	天臣医疗	2,902	139,528.16	0.10
228	688485	九州一轨	7,784	138,866.56	0.10
229	688428	诺诚健华	6,766	138,838.32	0.10
230	688110	东芯股份	1,046	137,392.10	0.10
231	688671	碧兴物联	5,533	137,052.41	0.10
232	688108	赛诺医疗	7,091	136,430.84	0.10

233	688509	正元地信	24,829	136,311.21	0.10
234	688367	工大高科	4,397	136,131.12	0.10
235	688737	中自科技	6,012	134,909.28	0.10
236	688479	友车科技	7,150	134,634.50	0.10
237	688420	美腾科技	5,635	134,507.45	0.10
238	688665	四方光电	2,751	134,166.27	0.10
239	688355	明志科技	7,537	134,158.60	0.10
240	688601	力芯微	3,146	133,988.14	0.10
241	688285	高铁电气	15,346	133,203.28	0.10
242	688498	源杰科技	207	132,891.93	0.10
243	688236	春立医疗	5,787	132,406.56	0.10
244	688217	睿昂基因	5,019	132,250.65	0.10
245	688373	盟科药业	21,851	131,980.04	0.10
246	688613	奥精医疗	6,498	131,974.38	0.10
247	688115	思林杰	2,001	131,225.58	0.10
248	688597	煜邦电力	15,974	131,146.54	0.10
249	688655	迅捷兴	7,628	130,667.64	0.10
250	688246	嘉和美康	5,542	128,851.50	0.10
251	688049	炬芯科技	2,427	127,660.20	0.09
252	688561	奇安信	3,578	127,305.24	0.09
253	688295	中复神鹰	3,816	125,202.96	0.09
254	688065	凯赛生物	2,500	124,500.00	0.09
255	688701	卓锦股份	15,206	123,928.90	0.09
256	688589	力合微	5,437	123,691.75	0.09
257	688584	上海合晶	5,579	122,403.26	0.09
258	688335	复洁科技	4,520	121,859.20	0.09
259	688261	东微半导	1,470	120,554.70	0.09
260	688685	迈信林	2,170	120,391.60	0.09
261	688315	诺禾致源	8,863	117,700.64	0.09
262	688656	浩欧博	760	116,888.00	0.09
263	688179	阿拉丁	9,266	115,732.34	0.09
264	688652	京仪装备	1,163	114,334.53	0.08
265	688016	心脉医疗	1,247	114,300.02	0.08
266	688525	佰维存储	994	114,101.26	0.08
267	688112	鼎阳科技	2,961	110,889.45	0.08
268	688289	圣湘生物	5,750	108,732.50	0.08
269	688181	八亿时空	3,269	105,654.08	0.08
270	688739	成大生物	3,919	100,953.44	0.07
271	688199	久日新材	4,156	97,956.92	0.07
272	688185	康希诺	1,557	97,857.45	0.07
273	688787	海天瑞声	839	97,315.61	0.07
274	688378	奥来德	3,551	96,942.30	0.07
275	688281	华秦科技	1,313	96,899.40	0.07

276	688219	会通股份	7,662	95,162.04	0.07
277	688388	嘉元科技	2,322	95,155.56	0.07
278	688189	南新制药	11,930	95,082.10	0.07
279	688071	华依科技	2,862	94,932.54	0.07
280	688680	海优新材	2,223	85,029.75	0.06
281	688593	新相微	4,174	84,231.32	0.06
282	688058	宝兰德	2,955	80,464.65	0.06
283	688046	药康生物	5,176	79,503.36	0.06
284	688059	华锐精密	1,004	79,014.80	0.06
285	688786	悦安新材	2,774	78,254.54	0.06
286	688162	巨一科技	2,459	75,737.20	0.06
287	688334	西高院	3,853	74,594.08	0.06
288	688255	凯尔达	1,878	68,791.14	0.05
289	688558	国盛智科	2,366	68,448.38	0.05
290	688155	先惠技术	1,126	68,066.70	0.05
291	688607	康众医疗	1,497	64,071.60	0.05
292	688363	华熙生物	1,460	63,772.80	0.05
293	688105	诺唯赞	3,093	61,921.86	0.05
294	688326	经纬恒润	504	59,220.00	0.04
295	688306	均普智能	5,082	58,951.20	0.04
296	688260	昀冢科技	2,042	58,809.60	0.04
297	688529	豪森智能	3,120	57,532.80	0.04
298	688192	迪哲医药	997	57,427.20	0.04
299	688551	科威尔	1,556	57,307.48	0.04
300	688267	中触媒	2,011	56,649.87	0.04
301	688161	威高骨科	2,026	56,565.92	0.04
302	688553	汇宇制药	3,129	55,664.91	0.04
303	688176	亚虹医药	4,674	53,797.74	0.04
304	688218	江苏北人	2,330	53,170.60	0.04
305	688087	英科再生	1,697	52,301.54	0.04
306	688659	元琛科技	5,511	52,078.95	0.04
307	688178	万德斯	2,128	51,135.84	0.04
308	688085	三友医疗	2,783	50,149.66	0.04
309	688233	神工股份	710	49,721.30	0.04
310	688132	邦彦技术	2,556	47,081.52	0.03
311	688275	万润新能	562	42,374.80	0.03
312	688276	百克生物	2,191	41,322.26	0.03
313	688310	迈得医疗	2,693	41,283.69	0.03
314	688328	深科达	1,402	40,910.36	0.03
315	688113	联测科技	936	37,000.08	0.03
316	688298	东方生物	1,521	35,637.03	0.03
317	688232	新点软件	1,374	34,102.68	0.03
318	688177	百奥泰	1,409	32,604.26	0.02

319	688505	复旦张江	3,878	32,187.40	0.02
320	688419	耐科装备	1,130	31,628.70	0.02
321	688565	力源科技	2,792	31,242.48	0.02
322	688531	日联科技	446	29,449.38	0.02
323	688600	皖仪科技	1,144	28,657.20	0.02
324	688007	光峰科技	1,539	28,579.23	0.02
325	688575	亚辉龙	1,976	28,059.20	0.02
326	688720	艾森股份	391	27,518.58	0.02
327	688625	呈和科技	664	27,356.80	0.02
328	688393	安必平	1,149	27,219.81	0.02
329	688560	明冠新材	1,862	26,607.98	0.02
330	688093	世华科技	693	25,537.05	0.02
331	688389	普门科技	1,695	22,001.10	0.02
332	688015	交控科技	928	21,139.84	0.02
333	688247	宣泰医药	2,118	20,544.60	0.02
334	688206	概伦电子	579	20,166.57	0.01
335	688484	南芯科技	488	19,842.08	0.01
336	688459	哈铁科技	1,922	18,547.30	0.01
337	688468	科美诊断	2,462	18,071.08	0.01
338	688029	南微医学	200	16,312.00	0.01
339	688633	星球石墨	645	15,273.60	0.01
340	688610	埃科光电	193	11,929.33	0.01
341	688092	爱科科技	471	11,840.94	0.01
342	688586	江航装备	691	9,010.64	0.01
343	688006	杭可科技	174	5,096.46	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	400	550,872.00	0.41
2	300972	万辰集团	1,900	382,033.00	0.28
3	000100	TCL 科技	73,400	333,236.00	0.25
4	300115	长盈精密	7,000	325,500.00	0.24
5	301171	易点天下	7,200	291,600.00	0.22
6	002185	华天科技	22,700	249,019.00	0.18
7	300136	信维通信	2,500	155,000.00	0.11
8	300857	协创数据	900	151,812.00	0.11
9	001389	广合科技	1,600	130,608.00	0.10
10	601088	中国神华	3,200	129,600.00	0.10
11	601360	三六零	11,600	129,572.00	0.10
12	002444	巨星科技	3,800	129,276.00	0.10
13	002027	分众传媒	17,500	128,975.00	0.10
14	603993	洛阳钼业	6,400	128,000.00	0.09
15	600415	小商品城	8,000	127,600.00	0.09

16	300570	太辰光	1,100	127,105.00	0.09
17	603296	华勤技术	1,400	127,036.00	0.09
18	603259	药明康德	1,400	126,896.00	0.09
19	600887	伊利股份	4,400	125,840.00	0.09
20	600050	中国联通	24,600	125,706.00	0.09
21	600487	亨通光电	5,000	123,650.00	0.09
22	301606	绿联科技	2,100	123,354.00	0.09
23	002901	大博医疗	2,600	123,162.00	0.09
24	000975	山金国际	5,000	121,650.00	0.09
25	601179	中国西电	13,300	121,030.00	0.09
26	300821	东岳硅材	9,900	115,434.00	0.09
27	600550	保变电气	10,900	114,995.00	0.09
28	300059	东方财富	4,700	108,946.00	0.08
29	002612	朗姿股份	4,300	87,892.00	0.07
30	605117	德业股份	800	68,960.00	0.05
31	002314	南山控股	21,200	60,420.00	0.04
32	300628	亿联网络	1,600	57,040.00	0.04
33	688727	恒坤新材	315	10,984.05	0.01
34	601899	紫金矿业	300	10,341.00	0.01
35	603175	超颖电子	141	6,846.96	0.01
36	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
37	688796	百奥赛图	141	5,957.25	0.00
38	603092	德力佳	52	2,894.32	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	85,052,664.32	63.10
2	688041	海光信息	67,381,255.52	49.99
3	688981	中芯国际	36,443,487.23	27.04
4	688111	金山办公	31,816,966.48	23.60
5	688012	中微公司	27,442,900.43	20.36
6	688506	百利天恒	20,864,172.49	15.48
7	688008	澜起科技	18,208,411.54	13.51
8	688036	传音控股	14,870,517.02	11.03
9	688082	盛美上海	14,319,518.30	10.62
10	688469	芯联集成	14,250,501.28	10.57
11	688271	联影医疗	13,401,816.34	9.94
12	688538	和辉光电	12,553,412.02	9.31
13	688072	拓荆科技	11,354,935.12	8.42
14	688385	复旦微电	10,496,040.50	7.79
15	688361	中科飞测	10,280,351.17	7.63
16	688047	龙芯中科	10,263,221.88	7.61

17	688249	晶合集成	10,010,730.94	7.43
18	688180	君实生物	9,065,730.37	6.73
19	688321	微芯生物	8,849,903.93	6.57
20	688107	安路科技	8,729,512.25	6.48
21	688387	信科移动	8,527,965.06	6.33
22	688126	沪硅产业	8,486,175.03	6.30
23	688484	南芯科技	8,420,253.47	6.25
24	688009	中国通号	8,231,629.48	6.11
25	688396	华润微	8,110,600.64	6.02
26	688728	格科微	8,108,783.92	6.02
27	688472	阿特斯	7,908,648.96	5.87
28	688388	嘉元科技	7,819,861.41	5.80
29	688772	珠海冠宇	7,648,835.63	5.67
30	688213	思特威	7,476,639.38	5.55
31	688702	盛科通信	7,358,350.81	5.46
32	688210	统联精密	7,191,843.92	5.34
33	688148	芳源股份	7,167,028.81	5.32
34	688668	鼎通科技	6,919,473.14	5.13
35	688029	南微医学	6,736,459.62	5.00
36	688122	西部超导	6,703,505.86	4.97
37	688582	芯动联科	6,652,210.24	4.93
38	688549	中巨芯	6,608,857.59	4.90
39	688002	睿创微纳	6,554,500.54	4.86
40	688079	美迪凯	6,385,107.52	4.74
41	688278	特宝生物	6,313,302.72	4.68
42	688521	芯原股份	6,243,610.37	4.63
43	688018	乐鑫科技	6,236,831.39	4.63
44	688281	华秦科技	6,227,191.11	4.62
45	688777	中控技术	6,219,010.73	4.61
46	688208	道通科技	6,208,559.78	4.61
47	688058	宝兰德	6,205,852.62	4.60
48	688295	中复神鹰	6,195,505.78	4.60
49	688027	国盾量子	6,160,667.44	4.57
50	688223	晶科能源	6,146,512.26	4.56
51	688515	裕太微	6,117,063.47	4.54
52	688049	炬芯科技	6,083,009.61	4.51
53	688006	杭可科技	6,054,764.73	4.49
54	688185	康希诺	6,026,573.39	4.47
55	688371	菲沃泰	5,995,387.30	4.45
56	688475	萤石网络	5,908,475.61	4.38
57	688612	威迈斯	5,905,153.61	4.38
58	688007	光峰科技	5,892,153.93	4.37
59	688779	五矿新能	5,871,460.82	4.36

60	688020	方邦股份	5,826,877.03	4.32
61	688329	艾隆科技	5,707,316.91	4.23
62	688238	和元生物	5,683,129.68	4.22
63	688617	惠泰医疗	5,631,825.07	4.18
64	688114	华大智造	5,604,615.79	4.16
65	689009	九号公司	5,599,091.31	4.15
66	688327	云从科技	5,468,379.24	4.06
67	688578	艾力斯	5,465,231.05	4.05
68	688523	航天环宇	5,445,048.46	4.04
69	688097	博众精工	5,433,816.70	4.03
70	688520	神州细胞	5,394,675.61	4.00
71	688607	康众医疗	5,341,995.19	3.96
72	688100	威胜信息	5,313,851.66	3.94
73	688172	燕东微	5,212,765.84	3.87
74	688176	亚虹医药	5,198,795.50	3.86
75	688711	宏微科技	5,128,408.83	3.80
76	688681	科汇股份	5,097,178.11	3.78
77	688019	安集科技	5,064,165.34	3.76
78	688303	大全能源	5,050,398.73	3.75
79	688030	山石网科	5,034,651.62	3.73
80	688128	中国电研	4,981,542.69	3.70
81	688709	成都华微	4,973,686.79	3.69
82	688425	铁建重工	4,973,200.72	3.69
83	688432	有研硅	4,947,946.99	3.67
84	688187	时代电气	4,943,967.87	3.67
85	688409	富创精密	4,890,080.80	3.63
86	688707	振华新材	4,881,062.55	3.62
87	688183	生益电子	4,858,575.16	3.60
88	688373	盟科药业	4,779,968.04	3.55
89	688286	敏芯股份	4,764,186.74	3.53
90	688509	正元地信	4,738,707.81	3.52
91	688261	东微半导	4,718,227.04	3.50
92	688166	博瑞医药	4,712,889.56	3.50
93	688050	爱博医疗	4,655,435.37	3.45
94	688259	创耀科技	4,561,017.29	3.38
95	688609	九联科技	4,553,981.89	3.38
96	688375	国博电子	4,526,726.69	3.36
97	688235	百济神州	4,512,286.21	3.35
98	688399	硕世生物	4,488,108.90	3.33
99	688557	兰剑智能	4,435,302.45	3.29
100	688055	龙腾光电	4,427,008.88	3.28
101	688598	金博股份	4,411,056.09	3.27
102	688352	硕中科技	4,354,920.84	3.23

103	688141	杰华特	4,322,167.68	3.21
104	688568	中科星图	4,303,584.45	3.19
105	688348	昱能科技	4,284,450.34	3.18
106	688177	百奥泰	4,266,382.16	3.16
107	688280	精进电动	4,230,904.81	3.14
108	688685	迈信林	4,228,898.28	3.14
109	688595	芯海科技	4,194,395.88	3.11
110	688289	圣湘生物	4,156,795.24	3.08
111	688579	地纬智能	4,137,216.36	3.07
112	688439	振华风光	4,091,548.38	3.04
113	688606	奥泰生物	4,065,628.88	3.02
114	688248	南网科技	4,062,758.40	3.01
115	688382	益方生物	4,060,586.72	3.01
116	688719	爱科赛博	4,038,942.39	3.00
117	688272	富吉瑞	4,009,253.75	2.97
118	688088	虹软科技	4,007,228.53	2.97
119	688720	艾森股份	3,938,075.45	2.92
120	688192	迪哲医药	3,937,546.47	2.92
121	688325	赛微微电	3,935,116.26	2.92
122	688033	天宜新材	3,918,251.46	2.91
123	688358	祥生医疗	3,914,946.78	2.90
124	688219	会通股份	3,879,325.70	2.88
125	688638	誉辰智能	3,844,935.34	2.85
126	688505	复旦张江	3,814,655.65	2.83
127	688308	欧科亿	3,811,079.44	2.83
128	688193	仁度生物	3,809,219.87	2.83
129	688015	交控科技	3,792,121.55	2.81
130	688099	晶晨股份	3,784,449.03	2.81
131	688060	云涌科技	3,767,836.59	2.80
132	688525	佰维存储	3,756,306.10	2.79
133	688363	华熙生物	3,756,180.01	2.79
134	688005	容百科技	3,755,471.84	2.79
135	688739	成大生物	3,749,766.88	2.78
136	688611	杭州柯林	3,712,549.49	2.75
137	688288	鸿泉技术	3,702,686.63	2.75
138	688689	银河微电	3,694,400.06	2.74
139	688565	力源科技	3,691,055.54	2.74
140	688653	康希通信	3,632,080.94	2.69
141	688528	秦川物联	3,624,799.17	2.69
142	688021	奥福科技	3,595,132.55	2.67
143	688690	纳微科技	3,588,939.37	2.66
144	688468	科美诊断	3,566,486.17	2.65
145	688132	邦彦技术	3,559,021.69	2.64

146	688167	炬光科技	3,549,642.21	2.63
147	688563	航材股份	3,512,190.65	2.61
148	688630	芯碁微装	3,510,775.84	2.60
149	688589	力合微	3,492,392.72	2.59
150	688290	景业智能	3,480,866.92	2.58
151	688207	格灵深瞳	3,477,151.24	2.58
152	688686	奥普特	3,433,432.37	2.55
153	688306	均普智能	3,408,556.16	2.53
154	688092	爱科科技	3,363,746.40	2.50
155	688700	东威科技	3,355,083.90	2.49
156	688188	柏楚电子	3,333,927.80	2.47
157	688216	气派科技	3,313,683.15	2.46
158	688189	南新制药	3,309,904.98	2.46
159	688296	和达科技	3,308,986.43	2.45
160	688599	天合光能	3,297,678.79	2.45
161	688323	瑞华泰	3,295,594.34	2.44
162	688553	汇宇制药	3,267,679.58	2.42
163	688558	国盛智科	3,199,365.88	2.37
164	688262	国芯科技	3,185,562.52	2.36
165	688312	燕麦科技	3,166,838.26	2.35
166	688343	云天励飞	3,165,612.05	2.35
167	688169	石头科技	3,145,211.24	2.33
168	688068	热景生物	3,140,792.43	2.33
169	688416	恒烁股份	3,140,220.86	2.33
170	688217	睿昂基因	3,135,338.06	2.33
171	688125	安达智能	3,122,861.09	2.32
172	688349	三一重能	3,115,201.87	2.31
173	688331	荣昌生物	3,096,662.37	2.30
174	688067	爱威科技	3,050,671.72	2.26
175	688282	理工导航	3,047,075.54	2.26
176	688309	恒誉环保	3,045,172.22	2.26
177	688377	迪威尔	3,037,808.03	2.25
178	688561	奇安信	3,036,327.52	2.25
179	688347	华虹公司	3,034,283.30	2.25
180	688161	威高骨科	3,019,960.28	2.24
181	688701	卓锦股份	2,982,180.22	2.21
182	688778	厦钨新能	2,930,370.02	2.17
183	688671	碧兴物联	2,912,285.05	2.16
184	688601	力芯微	2,901,676.04	2.15
185	688001	华兴源创	2,888,185.86	2.14
186	688426	康为世纪	2,859,037.20	2.12
187	688608	恒玄科技	2,852,414.11	2.12
188	688011	新光光电	2,844,939.84	2.11

189	688403	汇成股份	2,843,236.17	2.11
190	688191	智洋创新	2,834,538.61	2.10
191	688093	世华科技	2,822,277.74	2.09
192	688279	峰昭科技	2,811,707.62	2.09
193	688519	南亚新材	2,762,877.79	2.05
194	688277	天智航	2,760,980.38	2.05
195	688123	聚辰股份	2,723,941.81	2.02

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	11,788,112.79	8.74
2	688027	国盾量子	6,382,225.06	4.73
3	688235	百济神州	4,992,716.50	3.70
4	688617	惠泰医疗	4,857,420.13	3.60
5	688019	安集科技	4,797,421.89	3.56
6	688012	中微公司	4,748,534.25	3.52
7	688018	乐鑫科技	4,480,968.68	3.32
8	688521	芯原股份	4,460,061.06	3.31
9	688082	盛美上海	3,990,961.29	2.96
10	688111	金山办公	3,977,187.52	2.95
11	688167	炬光科技	3,869,924.80	2.87
12	688006	杭可科技	3,490,144.38	2.59
13	688630	芯碁微装	3,289,479.19	2.44
14	688686	奥普特	3,213,008.80	2.38
15	688041	海光信息	3,204,786.63	2.38
16	688169	石头科技	2,992,253.65	2.22
17	688183	生益电子	2,950,711.96	2.19
18	688361	中科飞测	2,891,323.06	2.14
19	688388	嘉元科技	2,887,697.56	2.14
20	688210	统联精密	2,880,952.95	2.14
21	688578	艾力斯	2,874,026.27	2.13
22	688525	佰维存储	2,867,080.12	2.13
23	688148	芳源股份	2,752,128.09	2.04

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,676,653,891.80
卖出股票收入（成交）总额	573,404,864.44

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	2,495,660.72	1.85	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名的股票不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,810	70,517.13	5,820,500.00	4.56	121,815,500.00	95.44

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄志雄	5,000,000.00	3.92
2	方正证券股份有限公司	3,814,900.00	2.99
3	张燕	3,000,000.00	2.35
4	潘美容	2,790,000.00	2.19
5	宋成立	2,668,500.00	2.09
6	马涛	2,000,000.00	1.57
6	郑巧玲	2,000,000.00	1.57
8	刘仲恒	1,180,000.00	0.92
9	林琳	1,084,700.00	0.85
10	蒿小鸿	1,040,000.00	0.81

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 8 月 20 日） 基金份额总额	1,211,636,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	40,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	1,124,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	127,636,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

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

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无相关情况

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是容诚会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 40,000.00 元。该审计机构已经为本基金提供了 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无相关情况

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无相关情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	7	2,249,899,114.66	100.00	328,381.49	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。

4、本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华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产品资料概要》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月5日
2	《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托管协议》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月5日
3	《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份额上网发售提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025年8月5日
4	《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招募说明书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月5日
5	《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份额发售公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025年8月5日
6	《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合同》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月5日
7	《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合同及招募说明书提示性公告》	证券日报	2025年8月5日
8	《银华基金管理股份有限公司关于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提前结束募集的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025年8月15日
9	《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产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月18日
10	《银华基金管理股份有限公司关于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变更基金扩位简称的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025年8月18日
11	《银华基金管理股份有限公司关于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合同生效公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025年8月21日
12	《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上市交易公告书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年8月26日
13	《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上市交易公告书提示性公告》	证券日报	2025年8月26日

14	《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开放日常申购、赎回业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025 年 8 月 26 日
15	《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上市交易提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券日报	2025 年 8 月 29 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于增加长城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, 证券时报, 证券日报, 上海证券报	2025 年 10 月 24 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于增加湘财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, 证券时报, 中国证券报, 证券日报	2025 年 11 月 14 日
18	《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招募说明书更新(2025 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 24 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告》	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 11 月 24 日
20	《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产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 24 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2025 年 12 月 26 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华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募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《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招募说明书》

13.1.3 《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合同》

13.1.4 《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托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2026年3月28日