

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证
券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
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	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪港深
场内简称	沪港深（扩位证券简称：沪港深 500ETF 银华）
基金主代码	517000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 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	132,793,000.00 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	2021 年 3 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。 建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，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，主要采用完全复制法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。本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,832,774.99
本期利润	619,435.84
加权平均基金份额本期利润	0.0037
本期加权平均净值利润率	0.36%
本期基金份额净值增长率	-0.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-18,843,395.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1419
期末基金资产净值	135,031,074.46
期末基金份额净值	1.0169
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.69%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、

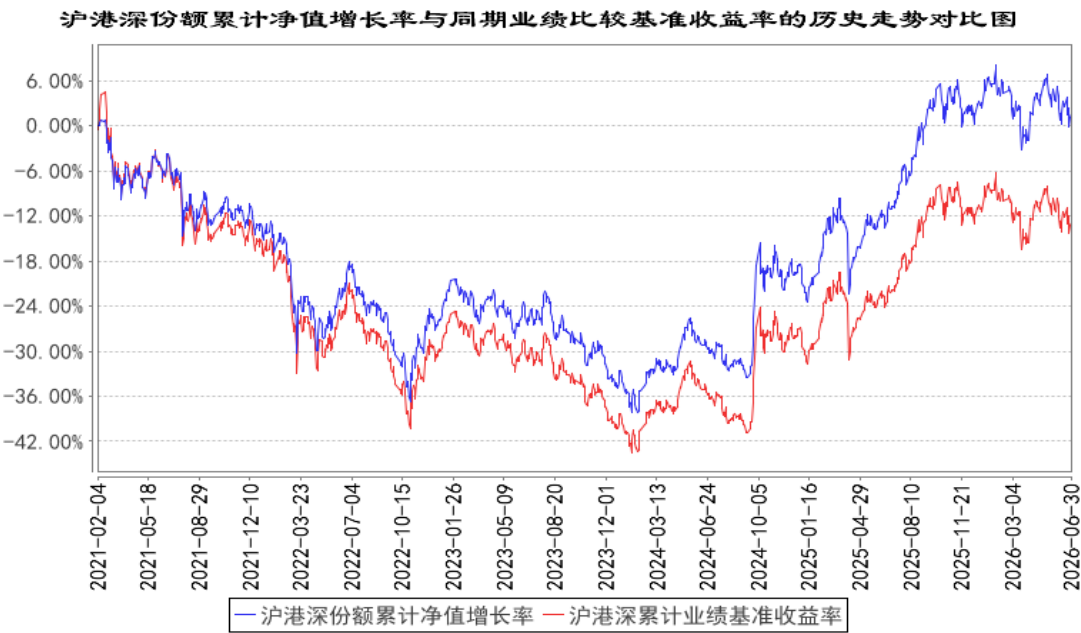
申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.00%	1.09%	3.40%	1.10%	0.60%	-0.01%
过去六个月	-0.74%	1.06%	-1.67%	1.08%	0.93%	-0.02%
过去一年	14.39%	0.97%	11.89%	0.98%	2.50%	-0.01%
过去三年	36.77%	1.08%	25.55%	1.11%	11.22%	-0.03%
过去五年	6.30%	1.12%	-8.56%	1.15%	14.86%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.69%	1.11%	-12.90%	1.15%	14.59%	-0.04%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户

资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2026 年 6 月底，银华基金管理公募基金 255 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	—	13.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日至 2023 年 4 月 12 日兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理，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 年 1 月 23 日兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 26 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 8 月 23 日至 2025 年 10 月 23 日兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自
--	--	--	--	---

					2024 年 1 月 25 日至 2026 年 8 月 19 日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 日至 2026 年 8 月 19 日兼任银华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2025 年 4 月 9 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 8 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 8 月 29 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2026 年 1 月 28 日起兼任银华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2026 年 7 月 21 日起兼任银华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张卓希女士	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 22 日	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永（中国）企业咨询有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
郭九良先生	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理股份有限公司，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《证券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、《银华中证沪港深 500 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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内(1 日内、3 日内及 5 日内)同向交易的交易价差从 T 检验(置信度为 95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年,国内宏观调控政策持续发力,内需修复进程延续推进。消费品以旧换新补贴等政策持续实施,春节、清明、五一等多轮假期配套各地线下促消费专项活动,居民出行、终端商品消费景气度呈现企稳回升。依托海外出口需求韧性与国内稳内需政策双向支撑,制造业 PMI 连续多月运行于扩张区间,生产端与需求端同步实现边际改善。海外方面,中东地缘冲突反复扰动大宗商品,原油高位震荡,黄金冲高回落;美国通胀数据波动扩大,美联储上半年维持高基准利率不变,持续释放货币政策中长期偏紧信号,美元指数整体保持强势,新兴市场持续面临资本外流、本币汇率承压的双重压力。在上述因素的作用下,A 股和港股市场在上半年呈现典型的结构性行情。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0169 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.74%，业绩比较基准收益率为-1.67%。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 4%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,404,369.72	12,128,767.49
结算备付金		15,155.45	29,220.34
存出保证金		6,273.28	27,491.98
交易性金融资产	6.4.7.2	131,093,365.63	208,186,462.37
其中：股票投资		131,093,365.63	208,186,462.37
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		2,838,284.09	-
应收股利		224,019.02	191,232.83
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		138,581,467.19	220,563,175.01
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,393,712.97	2,270,755.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		59,623.00	94,423.00
应付托管费		11,924.60	18,884.65
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	85,132.16	169,244.15
负债合计		3,550,392.73	2,553,306.83
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	132,793,000.00	212,793,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,238,074.46	5,216,868.18
净资产合计		135,031,074.46	218,009,868.18
负债和净资产总计		138,581,467.19	220,563,175.01

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0169 元，基金份额总额 132,793,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,217,794.99	37,200,402.55

1. 利息收入		12,698.05	37,903.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,698.05	37,903.24
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）		8,179,763.36	-2,097,463.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,508,232.17	-7,288,134.77
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	1,671,531.19	5,190,671.47
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	-7,213,339.15	39,511,249.62
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	238,672.73	-251,287.01
减：二、营业总支出		598,359.15	1,190,943.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	429,115.18	919,573.15
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,823.03	183,914.61
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	83,420.94	87,455.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		619,435.84	36,009,459.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		619,435.84	36,009,459.32

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		619,435.84	36,009,459.32

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	212,793,000.00	-	5,216,868.18	218,009,868.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	212,793,000.00	-	5,216,868.18	218,009,868.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-80,000,000.00	-	-2,978,793.72	-82,978,793.72
（一）、综合收益总额	-	-	619,435.84	619,435.84
（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）	-80,000,000.00	-	-3,598,229.56	-83,598,229.56
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-80,000,000.00	-	-3,598,229.56	-83,598,229.56
（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	132,793,000.00	-	2,238,074.46	135,031,074.46
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	487,793,000.00	-	-92,957,317.51	394,835,682.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	487,793,000.00	-	-92,957,317.51	394,835,682.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-85,000,000.00	-	48,265,000.60	-36,734,999.40
（一）、综合收益总额	-	-	36,009,459.32	36,009,459.32
（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）	-85,000,000.00	-	12,255,541.28	-72,744,458.72
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	-1,336,517.55	8,663,482.45
2. 基金赎回款	-95,000,000.00	-	13,592,058.83	-81,407,941.17
（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	402,793,000.00	-	-44,692,316.91	358,100,683.09

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：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证沪港深 500 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[2020]3526 号《关于银华中证沪港深 500 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《银华中证沪港深 500 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 1,482,793,000.00 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(2021)第 0165 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,482,793,000.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管通知书[2021]76 号核准,本基金 1,482,793,000.00 份基金份额于 2021 年 3 月 5 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《银华中证沪港深 500 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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,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(包括中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、港股通标的股票)、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、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等)、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、金融衍生工具(包括股指期货、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：中证沪港深 500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政

策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,404,369.72
等于：本金	4,403,918.96
加：应计利息	450.76
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	4,404,369.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	122,526,683.72	-	131,093,365.63	8,566,681.91
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	122,526,683.72	-	131,093,365.63	8,566,681.91

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,789.00
其中：交易所市场	5,789.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	85,132.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	212,793,000.00	212,793,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-80,000,000.00	-80,000,000.00
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	132,793,000.00	132,793,000.00

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	-39,758,587.22	44,975,455.40	5,216,868.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-39,758,587.22	44,975,455.40	5,216,868.18
本期利润	7,832,774.99	-7,213,339.15	619,435.84
本期基金份额交易产生的变动数	13,082,417.03	-16,680,646.59	-3,598,229.56
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	13,082,417.03	-16,680,646.59	-3,598,229.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,843,395.20	21,081,469.66	2,238,074.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,123.79
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	552.88
其他	21.38
合计	12,698.05

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,811,955.72
股票投资收益——赎回差价收入	1,696,276.45
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	6,508,232.17

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	61,549,439.00
减：卖出股票成本总额	56,664,030.88
减：交易费用	73,452.40
买卖股票差价收入	4,811,955.72

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	83,598,229.56
减：现金支付赎回款总额	56,368,898.56
减：赎回股票成本总额	25,533,054.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,696,276.45

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,671,531.19
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	1,671,531.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,213,339.15
股票投资	-7,213,339.15
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	-7,213,339.15

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	238,672.73
合计	238,672.73

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,256.29
其他	2,821.49
合计	83,420.94

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	429,115.18	919,573.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	157,428.67	63,069.48
应支付基金管理人的净管理费	271,686.51	856,503.67

注：本基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,823.03	183,914.61

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,404,369.72	12,123.79	18,501,614.35	37,288.65

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

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）发行的股票：招商银行（代码 600036）33,500.00 股，期末公允价值为人民币 1,189,250.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.88%；招商银行（代码 3968）12,500.00 股，期末公允价值为人民币 487,690.83 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.36%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：中国交建（代码 601800）9,600.00 股，期末公允价值为人民币 54,816.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.04%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：上汽集团（600104）12,300.00 股，期末公允价值为人民币 120,048.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.09%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	185	2,068.30	3,254.15	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	42	1,590.96	1,464.54	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	54	4,977.72	25,010.10	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	86	4,811.70	4,910.60	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	632	5,985.04	44,328.48	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板、创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆	2026	重大事	832.00	2026	890.99	554	123,548.58	460,928.00	-

	科技	年 6 月 29 日	项停牌		年 7 月 13 日					
--	----	------------------	-----	--	---------------	--	--	--	--	--

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,404,369.72	-	-	-	4,404,369.72
结算备付金	15,155.45	-	-	-	15,155.45

存出保证金	6,273.28	-	-	-	6,273.28
交易性金融资产	-	-	-	-131,093,365.63	131,093,365.63
应收股利	-	-	-	224,019.02	224,019.02
应收清算款	-	-	-	2,838,284.09	2,838,284.09
资产总计	4,425,798.45	-	-	-134,155,668.74	138,581,467.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	59,623.00	59,623.00
应付托管费	-	-	-	11,924.60	11,924.60
应付清算款	-	-	-	3,393,712.97	3,393,712.97
其他负债	-	-	-	85,132.16	85,132.16
负债总计	-	-	-	3,550,392.73	3,550,392.73
利率敏感度缺口	4,425,798.45	-	-	-130,605,276.01	135,031,074.46
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,128,767.49	-	-	-	12,128,767.49
结算备付金	29,220.34	-	-	-	29,220.34
存出保证金	27,491.98	-	-	-	27,491.98
交易性金融资产	-	-	-	-208,186,462.37	208,186,462.37
应收股利	-	-	-	191,232.83	191,232.83
资产总计	12,185,479.81	-	-	-208,377,695.20	220,563,175.01
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	94,423.00	94,423.00
应付托管费	-	-	-	18,884.65	18,884.65
应付清算款	-	-	-	2,270,755.03	2,270,755.03
其他负债	-	-	-	169,244.15	169,244.15
负债总计	-	-	-	2,553,306.83	2,553,306.83
利率敏感度缺口	12,185,479.81	-	-	-205,824,388.37	218,009,868.18

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	48,324,522.20	-	48,324,522.20
资产合计	-	48,324,522.20	-	48,324,522.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	48,324,522.20	-	48,324,522.20
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	91,638,142.81	-	91,638,142.81
资产合计	-	91,638,142.81	-	91,638,142.81
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	91,638,142.81	-	91,638,142.81

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变。		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币-5%	-2,416,226.11	-4,581,907.14

	港币 5%	2, 416, 226. 11	4, 581, 907. 14
--	-------	-----------------	-----------------

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

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

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

6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	131, 093, 365. 63	97. 08	208, 186, 462. 37	95. 49
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	131, 093, 365. 63	97. 08	208, 186, 462. 37	95. 49

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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,619,676.68	10,405,245.17
	业绩比较基准下降 5%	-6,619,676.68	-10,405,245.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	130,553,469.76	207,183,003.64
第二层次	460,928.00	772,505.16
第三层次	78,967.87	230,953.57
合计	131,093,365.63	208,186,462.37

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	131,093,365.63	94.60
	其中：股票	131,093,365.63	94.60
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	4,419,525.17	3.19
8	其他各项资产	3,068,576.39	2.21
9	合计	138,581,467.19	100.00

注：1、股票投资含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 48,324,522.20 元，占期末净值比例为 35.79%。

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	432,835.00	0.32
B	采矿业	3,640,667.95	2.70
C	制造业	53,628,930.37	39.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,943,438.00	1.44

E	建筑业	869,562.20	0.64
F	批发和零售业	127,494.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,865,593.26	1.38
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,692,579.85	3.48
J	金融业	13,751,197.30	10.18
K	房地产业	342,167.00	0.25
L	租赁和商务服务业	350,786.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	897,066.35	0.66
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	104,307.28	0.08
R	文化、体育和娱乐业	43,251.00	0.03
S	综合	—	—
	合计	82,689,875.56	61.24

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	78,967.87	0.06
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	—	—
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	—	—
N	水利、环境和公共	—	—

	设施管理业		
0	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	78,967.87	0.06

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	817,366.35	0.61
消费者非必需品	8,222,292.74	6.09
消费者常用品	908,296.60	0.67
能源	1,917,063.56	1.42
金融	17,860,157.81	13.23
医疗保健	1,944,514.09	1.44
工业	2,220,404.65	1.64
信息技术	3,298,441.96	2.44
电信服务	8,269,111.93	6.12
公用事业	1,187,312.20	0.88
地产建筑业	1,679,560.31	1.24
合计	48,324,522.20	35.79

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	00700	腾讯控股	17,200	6,420,807.99	4.76
2	00005	汇丰控股	46,800	6,011,859.91	4.45
3	09988	阿里巴巴-W	51,900	4,185,468.62	3.10
4	300308	中际旭创	3,000	3,810,000.00	2.82
5	300750	宁德时代	7,091	2,786,833.91	2.06
5	03750	宁德时代	300	182,916.63	0.14
6	00939	建设银行	326,000	2,284,998.71	1.69
6	601939	建设银行	22,800	219,564.00	0.16
7	300502	新易盛	3,860	2,343,020.00	1.74
8	601318	中国平安	28,870	1,378,253.80	1.02
8	02318	中国平安	19,500	864,619.81	0.64
9	01398	工商银行	235,000	1,312,422.48	0.97
9	601398	工商银行	87,400	617,918.00	0.46
10	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	1.40
11	00981	中芯国际	13,000	1,009,428.81	0.75

11	688981	中芯国际	5,429	862,233.78	0.64
12	01299	友邦保险	28,400	1,762,444.29	1.31
13	600036	招商银行	33,500	1,189,250.00	0.88
13	03968	招商银行	12,500	487,690.83	0.36
14	601899	紫金矿业	44,600	1,121,244.00	0.83
14	02899	紫金矿业	18,000	428,368.86	0.32
15	688256	寒武纪	966	1,541,301.30	1.14
16	603986	兆易创新	1,780	1,450,700.00	1.07
17	00941	中国移动	17,000	1,124,381.40	0.83
17	600941	中国移动	2,400	206,712.00	0.15
18	01211	比亚迪股份	9,900	622,971.83	0.46
18	002594	比亚迪	7,300	581,810.00	0.43
19	000333	美的集团	13,100	989,443.00	0.73
19	00300	美的集团	1,700	121,961.79	0.09
20	00388	香港交易所	3,500	1,103,492.78	0.82
21	002371	北方华创	1,210	1,070,317.60	0.79
22	688012	中微公司	2,261	1,059,278.50	0.78
23	688041	海光信息	2,802	1,037,580.60	0.77
24	00883	中国海洋石油	48,000	847,148.93	0.63
24	600938	中国海油	6,400	173,760.00	0.13
25	03988	中国银行	181,000	784,465.67	0.58
25	601988	中国银行	38,700	221,364.00	0.16
26	03690	美团-W	16,720	994,767.69	0.74
27	002475	立讯精密	13,800	971,520.00	0.72
28	01810	小米集团-W	49,000	920,975.68	0.68
29	002384	东山精密	3,500	918,225.00	0.68
30	688008	澜起科技	2,916	903,668.40	0.67
31	600030	中信证券	26,410	758,759.30	0.56
31	06030	中信证券	5,500	130,221.70	0.10
32	600900	长江电力	33,100	876,157.00	0.65
33	02888	渣打集团	4,700	863,790.35	0.64
34	601288	农业银行	77,700	471,639.00	0.35
34	01288	农业银行	83,000	384,958.73	0.29
35	000725	京东方 A	98,300	853,244.00	0.63
36	603259	药明康德	6,560	816,785.60	0.60
37	601138	工业富联	10,700	772,005.00	0.57
38	601166	兴业银行	45,800	758,448.00	0.56
39	601328	交通银行	72,100	463,603.00	0.34
39	03328	交通银行	47,000	275,139.27	0.20
40	00857	中国石油股份	58,000	427,187.63	0.32
40	601857	中国石油	34,900	302,932.00	0.22
41	300059	东方财富	34,299	699,013.62	0.52
42	600183	生益科技	3,800	658,920.00	0.49

43	600276	恒瑞医药	12,040	626,561.60	0.46
44	02628	中国人寿	20,000	463,110.86	0.34
44	601628	中国人寿	4,400	155,540.00	0.12
45	300408	三环集团	3,700	617,530.00	0.46
46	300274	阳光电源	3,840	610,636.80	0.45
47	01088	中国神华	9,000	313,616.03	0.23
47	601088	中国神华	7,400	288,896.00	0.21
48	600487	亨通光电	5,300	579,502.00	0.43
49	002463	沪电股份	3,700	565,360.00	0.42
50	601211	国泰海通	30,578	556,519.60	0.41
51	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	0.41
52	688525	佰维存储	1,097	542,718.81	0.40
53	300394	天孚通信	1,728	523,031.04	0.39
54	00669	创科实业	4,500	506,147.51	0.37
55	000988	华工科技	2,700	498,447.00	0.37
56	301308	江波龙	700	492,660.00	0.36
57	000651	格力电器	12,500	468,750.00	0.35
58	600176	中国巨石	6,394	465,994.72	0.35
59	688072	拓荆科技	554	460,928.00	0.34
60	06160	百济神州	3,100	458,802.85	0.34
61	688521	芯原股份	1,218	452,048.52	0.33
62	600522	中天科技	7,300	442,964.00	0.33
63	00992	联想集团	22,000	439,868.46	0.33
64	601601	中国太保	9,200	262,384.00	0.19
64	02601	中国太保	7,600	177,434.34	0.13
65	600919	江苏银行	39,600	426,888.00	0.32
66	02388	中银香港	11,500	423,305.21	0.31
67	603019	中科曙光	3,900	418,197.00	0.31
68	603993	洛阳钼业	23,600	414,180.00	0.31
69	600150	中国船舶	12,149	410,514.71	0.30
70	600887	伊利股份	17,100	409,716.00	0.30
71	00386	中国石油化工股份	66,000	229,297.20	0.17
71	600028	中国石化	39,600	176,616.00	0.13
72	00001	长和	7,000	402,790.06	0.30
73	000338	潍柴动力	14,500	395,125.00	0.29
74	600584	长电科技	3,800	393,490.00	0.29
75	00016	新鸿基地产	4,000	390,152.66	0.29
76	000858	五粮液	5,232	387,168.00	0.29
77	01347	华虹宏力	2,000	373,823.92	0.28
78	002916	深南电路	810	370,899.00	0.27
79	601816	京沪高铁	79,300	359,229.00	0.27
80	601728	中国电信	42,000	217,980.00	0.16
80	00728	中国电信	36,000	133,513.51	0.10

81	600309	万华化学	5,100	348,891.00	0.26
82	01801	信达生物	5,000	345,682.90	0.26
83	300124	汇川技术	5,150	341,599.50	0.25
84	600690	海尔智家	10,100	206,141.00	0.15
84	06690	海尔智家	7,800	135,358.31	0.10
85	002415	海康威视	9,800	335,160.00	0.25
86	02269	药明生物	11,000	330,570.13	0.24
87	000100	TCL 科技	56,280	327,549.60	0.24
88	600111	北方稀土	6,800	326,740.00	0.24
89	601688	华泰证券	15,800	325,796.00	0.24
90	09992	泡泡玛特	2,400	322,475.24	0.24
91	000063	中兴通讯	8,800	318,472.00	0.24
92	00002	中电控股	5,000	317,889.30	0.24
93	600000	浦发银行	36,000	309,960.00	0.23
94	600089	特变电工	13,660	307,350.00	0.23
95	01024	快手-W	8,200	296,279.78	0.22
96	300433	蓝思科技	5,400	289,764.00	0.21
97	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.20
98	600031	三一重工	16,000	276,480.00	0.20
99	300223	君正股份	1,100	273,790.00	0.20
100	002050	三花智控	6,100	267,363.00	0.20
101	002142	宁波银行	8,990	266,913.10	0.20
102	000001	平安银行	26,300	264,315.00	0.20
103	300014	亿纬锂能	4,000	260,120.00	0.19
104	000792	盐湖股份	8,600	259,634.00	0.19
105	600549	厦门钨业	3,000	255,600.00	0.19
106	002714	牧原股份	7,300	255,427.00	0.19
107	002156	通富微电	3,300	250,371.00	0.19
108	09987	百胜中国	900	249,829.72	0.19
109	00175	吉利汽车	17,000	248,943.80	0.18
110	02328	中国财险	20,000	248,752.72	0.18
111	600406	国电南瑞	10,875	248,493.75	0.18
112	01109	华润置地	9,500	247,536.75	0.18
113	002353	杰瑞股份	1,600	244,000.00	0.18
114	601668	中国建筑	55,800	242,172.00	0.18
115	000657	中钨高新	2,500	239,300.00	0.18
116	00998	中信银行	24,000	138,620.58	0.10
116	601998	中信银行	14,300	99,099.00	0.07
117	601229	上海银行	26,784	232,485.12	0.17
118	01113	长实集团	6,000	230,235.23	0.17
119	601658	邮储银行	29,700	146,421.00	0.11
119	01658	邮储银行	21,000	83,354.74	0.06
120	688777	中控技术	1,939	227,832.50	0.17

121	002602	世纪华通	15,900	224,190.00	0.17
122	601919	中远海控	16,870	223,696.20	0.17
123	00006	电能实业	4,500	223,173.92	0.17
124	02020	安踏体育	3,600	222,157.72	0.16
125	688082	盛美上海	512	221,184.00	0.16
126	300760	迈瑞医疗	1,600	217,328.00	0.16
127	600660	福耀玻璃	4,300	216,892.00	0.16
128	600016	民生银行	67,100	216,062.00	0.16
129	601012	隆基绿能	16,460	215,955.20	0.16
130	603501	豪威集团	2,270	215,309.50	0.16
131	601225	陕西煤业	10,500	213,675.00	0.16
132	002230	科大讯飞	5,200	212,368.00	0.16
133	300033	同花顺	880	212,080.00	0.16
134	600999	招商证券	10,000	211,000.00	0.16
135	002460	赣锋锂业	3,080	201,432.00	0.15
136	601985	中国核电	22,200	200,466.00	0.15
137	002938	鹏鼎控股	1,900	200,222.00	0.15
138	002352	顺丰控股	6,400	200,064.00	0.15
139	600926	杭州银行	13,800	199,410.00	0.15
140	600160	巨化股份	3,700	196,137.00	0.15
141	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.15
142	601169	北京银行	39,900	195,510.00	0.14
143	603799	华友钴业	3,990	192,557.40	0.14
144	002709	天赐材料	3,700	190,291.00	0.14
145	000776	广发证券	8,000	187,200.00	0.14
146	02423	贝壳-W	5,700	185,949.61	0.14
147	09633	农夫山泉	5,400	185,824.54	0.14
148	01171	兖矿能源	10,400	99,813.77	0.07
148	600188	兖矿能源	4,735	84,140.95	0.06
149	01378	中国宏桥	10,500	182,942.69	0.14
150	300442	润泽科技	2,200	182,754.00	0.14
151	000938	紫光股份	6,300	181,818.00	0.13
152	09868	小鹏集团-W	4,100	180,367.44	0.13
153	000425	徐工机械	22,100	178,789.00	0.13
154	300498	温氏股份	14,400	177,408.00	0.13
155	002202	金风科技	7,400	176,860.00	0.13
156	601600	中国铝业	21,500	176,730.00	0.13
157	688126	沪硅产业	4,424	176,473.36	0.13
158	300661	圣邦股份	1,223	175,476.04	0.13
159	600460	士兰微	3,200	174,912.00	0.13
160	00003	香港中华煤气	30,950	174,730.55	0.13
161	00288	万洲国际	24,000	172,806.71	0.13
162	002466	天齐锂业	2,800	171,696.00	0.13

163	601766	中国中车	32,900	171,080.00	0.13
164	002600	领益智造	9,800	169,932.00	0.13
165	600050	中国联通	42,300	169,200.00	0.13
166	688249	晶合集成	2,857	168,648.71	0.12
167	601009	南京银行	16,700	165,163.00	0.12
168	002179	中航光电	3,522	162,716.40	0.12
169	600809	山西汾酒	1,460	159,680.20	0.12
170	002837	英维克	2,000	159,120.00	0.12
171	605117	德业股份	1,488	157,995.84	0.12
172	02015	理想汽车-W	3,900	156,088.86	0.12
173	601872	招商轮船	8,800	154,616.00	0.11
174	002049	紫光国微	1,740	154,425.00	0.11
175	03692	翰森制药	6,000	154,358.71	0.11
176	00027	银河娱乐	6,000	153,316.45	0.11
177	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.11
178	09926	康方生物	2,000	152,951.66	0.11
179	01519	极兔速递-W	21,000	152,482.64	0.11
180	601100	恒立液压	1,400	150,584.00	0.11
181	02057	中通快递-W	1,000	149,043.18	0.11
182	002241	歌尔股份	6,600	148,698.00	0.11
183	688396	华润微	1,518	148,080.90	0.11
184	601006	大秦铁路	32,100	147,981.00	0.11
185	603288	海天味业	4,461	147,926.76	0.11
186	000568	泸州老窖	1,900	147,288.00	0.11
187	00066	港铁公司	5,500	145,699.26	0.11
188	000408	藏格矿业	2,100	145,572.00	0.11
189	01093	石药集团	24,000	145,291.04	0.11
190	601818	光大银行	50,200	145,078.00	0.11
191	600905	三峡能源	38,500	142,835.00	0.11
192	600489	中金黄金	7,900	142,595.00	0.11
193	600893	航发动力	3,700	141,858.00	0.11
194	688111	金山办公	661	140,826.05	0.10
195	601888	中国中免	2,600	139,646.00	0.10
196	002625	光启技术	4,600	139,472.00	0.10
197	000630	铜陵有色	21,800	138,648.00	0.10
198	00267	中信股份	15,000	138,229.73	0.10
199	002027	分众传媒	28,300	136,972.00	0.10
200	688271	联影医疗	1,353	136,964.19	0.10
201	01308	海丰国际	5,000	136,275.50	0.10
202	600010	宝钢股份	61,100	136,253.00	0.10
203	601127	赛力斯	2,200	134,750.00	0.10
204	600958	东方证券	14,020	132,348.80	0.10
205	601336	新华保险	2,200	131,252.00	0.10

206	600760	中航沈飞	3,141	129,095.10	0.10
207	601689	拓普集团	2,285	128,919.70	0.10
208	600019	宝钢股份	23,600	128,148.00	0.09
209	688183	生益电子	962	127,368.80	0.09
210	02319	蒙牛乳业	9,000	125,774.73	0.09
211	000807	云铝股份	5,600	123,984.00	0.09
212	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.09
213	600989	宝丰能源	6,000	121,980.00	0.09
214	000426	兴业银锡	3,700	121,952.00	0.09
215	300450	先导智能	2,980	121,345.60	0.09
216	600362	江西铜业	2,800	121,240.00	0.09
217	00688	中国海外发展	11,500	120,459.20	0.09
218	601838	成都银行	6,800	120,360.00	0.09
219	600104	上汽集团	12,300	120,048.00	0.09
220	601168	西部矿业	4,400	119,416.00	0.09
221	601727	上海电气	17,000	119,000.00	0.09
222	01177	中国生物制药	31,000	118,739.47	0.09
223	601825	沪农商行	15,700	117,593.00	0.09
224	600885	宏发股份	3,388	116,852.12	0.09
225	002001	新 和 成	4,100	116,522.00	0.09
226	601995	中金公司	3,200	115,680.00	0.09
227	002422	科伦药业	3,000	115,560.00	0.09
228	601390	中国中铁	27,600	115,092.00	0.09
229	600875	东方电气	4,000	115,080.00	0.09
230	000538	云南白药	2,420	114,635.40	0.08
231	603893	瑞芯微	600	113,016.00	0.08
232	600795	国电电力	24,200	113,014.00	0.08
233	601377	兴业证券	18,710	113,008.40	0.08
234	000166	申万宏源	25,300	111,320.00	0.08
235	600547	山东黄金	4,800	110,832.00	0.08
236	603296	华勤技术	1,480	109,919.60	0.08
237	600015	华夏银行	17,100	109,269.00	0.08
238	601669	中国电建	23,200	109,040.00	0.08
239	600418	江淮汽车	4,200	108,486.00	0.08
240	600585	海螺水泥	6,400	108,480.00	0.08
241	300782	卓胜微	984	107,826.72	0.08
242	601916	浙商银行	40,840	107,409.20	0.08
243	00083	信和置业	12,000	107,144.33	0.08
244	00020	商汤-W	92,000	107,074.84	0.08
245	002648	卫星化学	4,532	106,456.68	0.08
246	600096	云天化	3,500	106,400.00	0.08
247	02382	舜宇光学科技	2,000	105,963.10	0.08
248	601698	中国卫通	3,500	105,875.00	0.08

249	601066	中信建投	3,600	104,652.00	0.08
250	300015	爱尔眼科	12,628	104,307.28	0.08
251	01038	长江基建集团	2,000	103,704.87	0.08
252	600346	恒力石化	5,800	102,718.00	0.08
253	300316	晶盛机电	1,700	102,680.00	0.08
254	002558	巨人网络	3,700	101,972.00	0.08
255	600482	中国动力	3,100	101,680.00	0.08
256	603228	景旺电子	1,400	101,374.00	0.08
257	601868	中国能建	37,800	100,926.00	0.07
258	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.07
259	09626	哔哩哔哩-W	880	100,661.47	0.07
260	002812	恩捷股份	1,500	100,365.00	0.07
261	688036	传音控股	1,691	99,684.45	0.07
262	605499	东鹏饮料	806	99,484.58	0.07
263	600580	卧龙电驱	3,000	99,300.00	0.07
264	600066	宇通客车	3,700	99,197.00	0.07
265	000066	中国长城	5,200	99,060.00	0.07
266	06618	京东健康	3,450	98,404.98	0.07
267	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.07
268	002311	海大集团	2,200	98,142.00	0.07
269	00788	中国铁塔	12,800	97,944.65	0.07
270	09660	地平线机器人-W	27,600	97,805.68	0.07
271	300418	昆仑万维	2,400	96,864.00	0.07
272	000625	长安汽车	13,484	96,680.28	0.07
273	01208	五矿资源	16,000	96,443.79	0.07
274	00762	中国联通	18,000	95,523.13	0.07
275	002532	天山铝业	8,800	94,424.00	0.07
276	000157	中联重科	13,500	94,095.00	0.07
276	600221	海航控股	69,700	94,095.00	0.07
277	688506	百利天恒	317	93,207.51	0.07
278	600895	张江高科	2,500	93,125.00	0.07
279	01997	九龙仓置业	5,000	92,848.00	0.07
280	02018	瑞声科技	2,500	92,717.71	0.07
281	600426	华鲁恒升	3,860	92,331.20	0.07
282	002340	格林美	13,800	91,218.00	0.07
283	688047	龙芯中科	587	90,791.29	0.07
284	600011	华能国际	11,900	90,321.00	0.07
285	600048	保利发展	19,500	90,285.00	0.07
286	000933	神火股份	4,200	89,040.00	0.07
287	600438	通威股份	7,300	88,403.00	0.07
288	00836	华润电力	6,000	88,175.20	0.07
289	01530	三生制药	6,000	88,018.86	0.07
290	600115	中国东航	23,100	88,011.00	0.07

291	002493	荣盛石化	8,150	87,612.50	0.06
292	002236	大华股份	5,300	87,397.00	0.06
293	000783	长江证券	8,900	86,775.00	0.06
294	601077	渝农商行	14,200	86,762.00	0.06
295	00012	恒基地产	4,000	86,160.16	0.06
296	601555	东吴证券	10,778	85,361.76	0.06
297	603659	璞泰来	2,946	85,227.78	0.06
298	600886	国投电力	6,400	85,184.00	0.06
299	600570	恒生电子	4,012	85,014.28	0.06
300	000301	东方盛虹	7,400	84,730.00	0.06
301	002736	国信证券	8,400	83,916.00	0.06
302	03808	中国重汽	2,500	83,684.79	0.06
303	00291	华润啤酒	4,500	83,172.35	0.06
304	02331	李宁	6,500	83,102.86	0.06
305	003816	中国广核	21,200	82,892.00	0.06
306	601360	三六零	9,500	82,555.00	0.06
307	02313	申洲国际	2,400	82,046.71	0.06
308	601058	赛轮轮胎	7,100	81,863.00	0.06
309	300339	润和软件	2,100	80,871.00	0.06
310	601901	方正证券	11,200	80,640.00	0.06
311	300759	康龙化成	2,775	80,280.75	0.06
312	002074	国轩高科	2,900	79,779.00	0.06
313	600026	中远海能	4,400	78,936.00	0.06
314	600196	复星医药	3,500	78,645.00	0.06
315	600009	上海机场	3,400	78,540.00	0.06
316	000768	中航西飞	3,800	77,824.00	0.06
317	601788	光大证券	5,300	76,479.00	0.06
318	601108	财通证券	8,840	76,466.00	0.06
319	601111	中国国航	12,600	76,230.00	0.06
320	06990	科伦博泰生物	200	75,772.30	0.06
321	601456	国联民生	8,500	75,140.00	0.06
322	600029	南方航空	14,500	75,110.00	0.06
323	600674	川投能源	5,300	75,101.00	0.06
324	000975	山金国际	4,400	74,800.00	0.06
325	600219	南山铝业	18,700	74,613.00	0.06
326	02268	药明合联	1,500	74,326.17	0.06
327	600415	小商品城	7,300	74,168.00	0.05
328	601881	中国银河	5,900	74,163.00	0.05
329	002128	电投能源	3,200	73,984.00	0.05
330	02688	新奥能源	2,100	73,797.22	0.05
331	002920	德赛西威	900	73,350.00	0.05
332	601186	中国铁建	12,300	73,185.00	0.05
333	601877	正泰电器	2,900	72,703.00	0.05

334	01928	金沙中国有限公司	6,400	72,541.30	0.05
335	002601	龙佰集团	4,400	72,512.00	0.05
336	600233	圆通速递	4,600	72,450.00	0.05
337	601117	中国化学	9,800	72,030.00	0.05
338	301269	华大九天	600	71,652.00	0.05
339	01818	招金矿业	5,000	71,177.67	0.05
340	00019	太古股份公司 A	1,000	70,960.54	0.05
341	601878	浙商证券	7,400	70,300.00	0.05
342	600372	中航机载	6,446	69,939.10	0.05
343	002595	豪迈科技	1,485	69,201.00	0.05
344	600839	四川长虹	9,900	69,102.00	0.05
345	301236	软通动力	1,600	67,920.00	0.05
346	00270	粤海投资	10,000	67,399.48	0.05
347	00135	昆仑能源	12,000	67,017.32	0.05
348	002653	海思科	1,000	66,340.00	0.05
349	600741	华域汽车	4,200	65,184.00	0.05
350	000963	华东医药	2,300	64,676.00	0.05
351	06862	海底捞	7,000	64,568.01	0.05
352	601021	春秋航空	1,400	63,812.00	0.05
353	01209	华润万象生活	2,000	63,716.83	0.05
354	00004	九龙仓集团	4,000	62,883.02	0.05
355	000895	双汇发展	2,800	62,720.00	0.05
356	300866	安克创新	600	62,700.00	0.05
357	001979	招商蛇口	9,700	62,371.00	0.05
358	601231	环旭电子	1,900	61,560.00	0.05
359	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.05
360	002304	洋河股份	1,600	61,040.00	0.05
361	601898	中煤能源	5,000	60,900.00	0.05
362	603606	东方电缆	1,460	60,604.60	0.04
363	06181	老铺黄金	200	60,173.14	0.04
364	000661	长春高新	900	59,940.00	0.04
365	002414	高德红外	4,505	59,736.30	0.04
366	601319	中国人保	8,800	59,488.00	0.04
367	00966	中国太平	3,800	59,474.83	0.04
368	600023	浙能电力	10,900	57,334.00	0.04
369	688169	石头科技	593	56,317.21	0.04
370	002078	太阳纸业	4,500	56,205.00	0.04
371	688728	格科微	2,662	56,008.48	0.04
372	002252	上海莱士	12,900	55,986.00	0.04
373	600039	四川路桥	7,060	55,209.20	0.04
374	02618	京东物流	5,400	55,109.50	0.04
375	601800	中国交建	9,600	54,816.00	0.04

376	000002	万 科 A	18,400	54,464.00	0.04
377	03888	金山软件	2,800	53,940.43	0.04
378	09863	零跑汽车	1,800	53,905.69	0.04
379	01972	太古地产	3,000	53,520.05	0.04
380	002064	华峰化学	5,600	53,144.00	0.04
381	00316	东方海外国际	500	52,981.55	0.04
382	688223	晶科能源	11,154	52,981.50	0.04
383	601633	长城汽车	3,500	52,815.00	0.04
384	302132	中航成飞	900	52,488.00	0.04
385	600600	青岛啤酒	1,000	52,230.00	0.04
386	03998	波司登	14,000	52,043.52	0.04
387	600588	用友网络	5,636	51,738.48	0.04
388	688599	天合光能	3,657	51,636.84	0.04
389	00268	金蝶国际	10,000	51,418.16	0.04
390	01929	周大福	5,400	51,122.85	0.04
391	00322	康师傅控股	6,000	50,966.51	0.04
392	000786	北新建材	2,800	50,652.00	0.04
393	300832	新产业	1,200	50,400.00	0.04
394	001965	招商公路	5,500	50,380.00	0.04
395	300628	亿联网络	1,440	48,700.80	0.04
396	603260	合盛硅业	1,000	48,260.00	0.04
397	00241	阿里健康	18,000	48,152.41	0.04
398	601607	上海医药	3,100	47,740.00	0.04
399	600027	华电国际	10,700	47,615.00	0.04
400	603369	今世缘	2,000	47,420.00	0.04
401	603806	福斯特	2,818	47,314.22	0.04
402	688187	时代电气	687	47,169.42	0.03
403	601699	潞安环能	3,300	47,124.00	0.03
404	601618	中国中冶	19,300	47,092.00	0.03
405	600642	申能股份	5,300	46,269.00	0.03
406	600918	中泰证券	8,600	45,752.00	0.03
407	00285	比亚迪电子	2,500	45,425.17	0.03
408	600061	国投资本	6,900	45,195.00	0.03
409	000617	中油资本	6,800	44,812.00	0.03
410	000983	山西焦煤	7,700	44,660.00	0.03
411	002294	信立泰	1,400	44,646.00	0.03
412	600025	华能水电	5,000	44,450.00	0.03
413	002459	晶澳科技	5,484	44,420.40	0.03
414	00151	中国旺旺	15,000	44,165.77	0.03
415	601059	信达证券	2,700	43,713.00	0.03
416	300251	光线传媒	3,900	43,251.00	0.03
417	00144	招商局港口	4,000	42,871.63	0.03
418	688472	阿特斯	3,941	42,641.62	0.03

419	02588	中银航空租赁	600	42,341.81	0.03
420	000958	电投产融	7,500	42,300.00	0.03
421	600515	海南机场	15,300	41,922.00	0.03
422	603195	公牛集团	1,068	41,812.20	0.03
423	00780	同程旅行	4,000	41,655.66	0.03
424	600085	同仁堂	1,800	41,598.00	0.03
425	601216	君正集团	9,000	40,140.00	0.03
426	000596	古井贡酒	500	39,900.00	0.03
427	00384	中国燃气	8,800	39,591.98	0.03
428	688188	柏楚电子	371	39,585.70	0.03
429	600803	新奥股份	2,500	39,500.00	0.03
430	600018	上港集团	8,300	39,176.00	0.03
431	300122	智飞生物	3,350	39,161.50	0.03
432	00960	龙湖集团	7,500	38,954.47	0.03
433	000876	新希望	6,200	38,874.00	0.03
434	600845	宝信软件	2,329	38,731.27	0.03
435	02259	紫金黄金国际	500	38,433.34	0.03
436	000999	华润三九	1,694	38,098.06	0.03
437	02367	巨子生物	1,600	36,826.52	0.03
438	300896	爱美客	420	36,624.00	0.03
439	000708	中信特钢	2,900	36,598.00	0.03
440	03311	中国建筑国际	6,000	36,322.76	0.03
441	002939	长城证券	4,300	35,862.00	0.03
442	300999	金龙鱼	1,500	34,890.00	0.03
443	301165	锐捷网络	420	33,789.00	0.03
444	001280	中国铀业	500	33,350.00	0.02
445	601018	宁波港	10,500	33,075.00	0.02
446	000932	华菱钢铁	9,500	32,965.00	0.02
447	300765	石药创新	1,200	32,676.00	0.02
448	688009	中国通号	6,774	32,244.24	0.02
449	01193	华润燃气	2,500	31,832.36	0.02
450	688303	大全能源	1,773	30,903.39	0.02
451	000987	越秀资本	3,930	30,732.60	0.02
452	06969	思摩尔国际	5,000	30,486.11	0.02
453	601238	广汽集团	6,000	30,480.00	0.02
454	300413	芒果超媒	2,000	29,260.00	0.02
455	09896	名创优品	1,400	28,672.57	0.02
456	603392	万泰生物	1,063	28,669.11	0.02
457	02282	美高梅中国	3,200	28,182.71	0.02
458	01876	百威亚太	4,600	24,371.51	0.02
459	00293	国泰航空	2,000	22,547.56	0.02
460	300979	华利集团	700	20,825.00	0.02
461	601136	首创证券	1,400	19,530.00	0.01

462	600968	海油发展	5,500	18,315.00	0.01
463	601808	中海油服	1,600	17,296.00	0.01
464	301638	南网数字	700	16,835.00	0.01
465	001391	国货航	3,858	15,702.06	0.01
466	601061	中信金属	1,400	15,078.00	0.01
467	601298	青岛港	1,800	14,490.00	0.01
468	301656	联合动力	700	12,061.00	0.01
469	002945	华林证券	800	10,744.00	0.01
470	09973	奇瑞汽车	500	10,570.25	0.01
471	01364	古茗	400	7,344.46	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	688818	电科蓝天	632	44,328.48	0.03
2	688785	恒运昌	54	25,010.10	0.02
3	688816	易思维	86	4,910.60	0.00
4	601112	振石股份	185	3,254.15	0.00
5	603284	林平发展	42	1,464.54	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	695,421.00	0.32
2	688525	佰维存储	372,461.37	0.17
3	02318	中国平安	230,655.96	0.11
3	601318	中国平安	64,408.00	0.03
4	002353	杰瑞股份	275,826.00	0.13
5	002602	世纪华通	248,887.00	0.11
6	300750	宁德时代	231,203.00	0.11
7	000657	中钨高新	221,329.00	0.10
8	688008	澜起科技	220,569.74	0.10
9	600549	厦门钨业	219,408.00	0.10
10	00700	腾讯控股	216,742.55	0.10
11	00001	长和	198,027.05	0.09
12	300476	胜宏科技	174,245.00	0.08
13	603986	兆易创新	165,182.00	0.08
14	000426	兴业银锡	158,282.00	0.07
15	01088	中国神华	97,345.98	0.04
15	601088	中国神华	56,969.00	0.03
16	002837	英维克	153,070.00	0.07
17	09988	阿里巴巴-W	144,618.66	0.07
18	01378	中国宏桥	142,913.61	0.07

19	300274	阳光电源	140,862.00	0.06
20	600118	中国卫星	132,965.00	0.06

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	00700	腾讯控股	5,067,450.29	2.32
2	09988	阿里巴巴-W	3,887,712.82	1.78
3	00005	汇丰控股	3,335,647.82	1.53
4	300750	宁德时代	1,847,993.00	0.85
5	300308	中际旭创	1,438,299.00	0.66
6	00939	建设银行	1,421,062.00	0.65
6	601939	建设银行	3,164.00	0.00
7	01299	友邦保险	1,261,043.90	0.58
8	01211	比亚迪股份	543,810.24	0.25
8	002594	比亚迪	452,850.00	0.21
9	02888	渣打集团	943,765.39	0.43
10	02318	中国平安	920,315.93	0.42
10	601318	中国平安	21,740.00	0.01
11	01810	小米集团-W	866,438.22	0.40
12	01398	工商银行	853,218.74	0.39
12	601398	工商银行	5,343.00	0.00
13	03988	中国银行	813,996.78	0.37
13	601988	中国银行	3,092.00	0.00
14	000333	美的集团	660,797.00	0.30
14	00300	美的集团	122,211.10	0.06
15	300502	新易盛	775,561.00	0.36
16	03690	美团-W	755,833.22	0.35
17	00388	香港交易所	726,702.67	0.33
18	00883	中国海洋石油	684,972.84	0.31
19	00941	中国移动	677,574.44	0.31
20	00981	中芯国际	522,348.22	0.24

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	12,317,327.84
卖出股票收入（成交）总额	61,549,439.00

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,273.28
2	应收清算款	2,838,284.09
3	应收股利	224,019.02
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,068,576.39

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

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	688818	电科蓝天	44,328.48	0.03	新股流通受限
2	688785	恒运昌	25,010.10	0.02	新股流通受限
3	688816	易思维	4,910.60	0.00	新股流通受限
4	601112	振石股份	3,254.15	0.00	新股流通受限
5	603284	林平发展	1,464.54	0.00	新股流通受限

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（%）
4,436	29,935.30	8,792,099.00	6.62	124,000,901.00	93.38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	1,482,793,000.00
本报告期期初基金份额总额	212,793,000.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	80,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	132,793,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国投证券	2	52,208,781.25	71.25	9,492.79	73.93	—
中信建投	2	21,065,116.67	28.75	3,347.23	26.07	—
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	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	2	—	—	—	—	—
华金证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	6	—	—	—	—	—
华西证券	4	—	—	—	—	—
华源证券	2	—	—	—	—	新增2个交易单元
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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
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	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2025 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 9 日
2	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 9 日
3	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 21 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 1 月 21 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 3 月 5 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 变更场内简称、扩位简称的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2026 年 3 月 27 日
7	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 27 日
8	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 28 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 3 月 28 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗	本基金管理人网站, 中	2026 年 4 月 1 日

	下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 4 月 17 日
12	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 4 月 21 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国国际金融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, 三大证券报	2026 年 5 月 9 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 5 月 21 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 6 月 8 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证沪港深 500 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 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2026 年 8 月 29 日