

银华长荣混合型证券投资基金 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	6
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
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	11
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	12
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	12
§ 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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
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	52
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	52

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	52
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 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	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	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华长荣混合型证券投资基金	
基金简称	银华长荣混合	
基金主代码	011855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 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	169,924,760.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	银华长荣混合 A	银华长荣混合 C
下属分级基金的交 易代码	011855	020977
报告期末下属分级 基金的份额总额	162,365,017.50 份	7,559,743.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握股票市场和债券市场的收益率变化，在控制风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例；根据国家政治经济政策精神，确定可投资的行业范围。本基金为混合型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，适当进行短期的战术避险选择。本基金将采用“自上而下”选择细分行业及“自下而上”的方式挑选公司。在选择细分行业的时候，遵循国家政治经济政策精神，选择国家明确支持的细分行业。在这些细分行业中，针对每一个公司从定性和定量两个角度对公司进行研究，从定性的角度分析公司的核心竞争力，包括公司的产品的竞争力、管理层经营能力、治理结构、经营机制、销售模式等方面是否能构建宽广的“护城河”；从定量的角度分析公司的成长性、财务状况和估值水平等指标是否达到标准。综合来看，具有持续性核心竞争力，并且在财务质量和价值方面达到要求的公司进入本基金的基础股票组合。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 60%—95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%）。其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、股指期货等金融工具；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市

	场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×10%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金如投资香港联合交易所上市的股票，将面临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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

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	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§ 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)	
	银华长荣混合 A	银华长荣混合 C

本期已实现收益	6,672,570.72	165,612.36
本期利润	-10,890,202.00	-499,463.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0523	-0.0726
本期加权平均净值利润率	-4.60%	-6.45%
本期基金份额净值增长率	-5.66%	-5.85%
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	12,741,492.85	516,279.33
期末可供分配基金份额利润	0.0785	0.0683
期末基金资产净值	175,106,510.35	8,076,022.70
期末基金份额净值	1.0785	1.0683
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	7.85%	18.77%

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

银华长荣混合 A

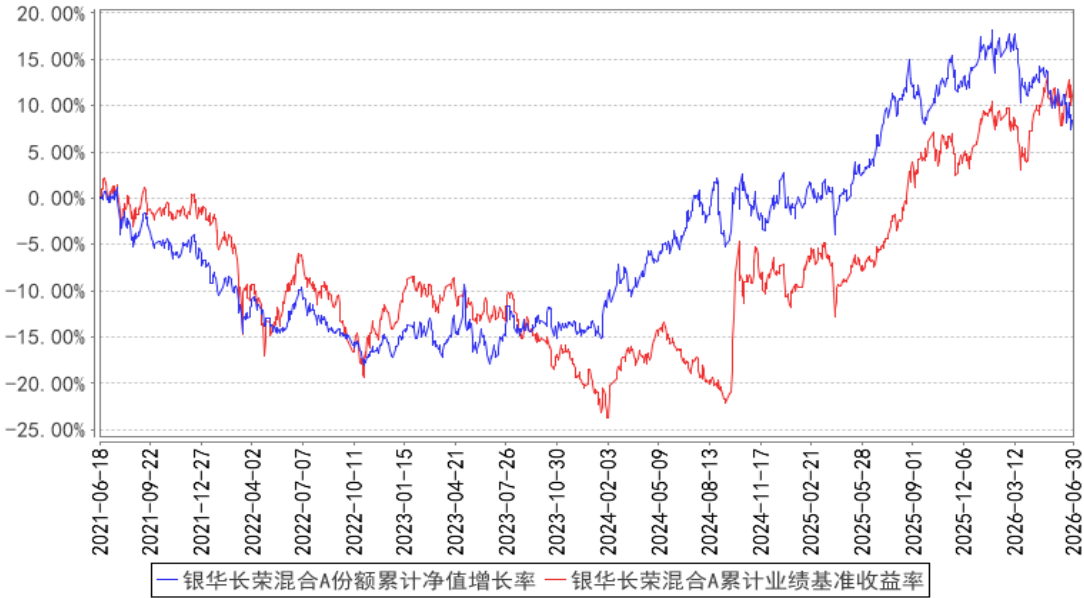
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.53%	0.69%	7.54%	0.88%	-11.07%	-0.19%
过去六个月	-5.66%	0.80%	5.84%	0.83%	-11.50%	-0.03%
过去一年	2.12%	0.71%	18.61%	0.74%	-16.49%	-0.03%
过去三年	29.66%	0.72%	28.15%	0.80%	1.51%	-0.08%
过去五年	7.07%	0.69%	10.04%	0.79%	-2.97%	-0.10%
自基金合同生效起至今	7.85%	0.68%	11.96%	0.79%	-4.11%	-0.11%

银华长荣混合 C

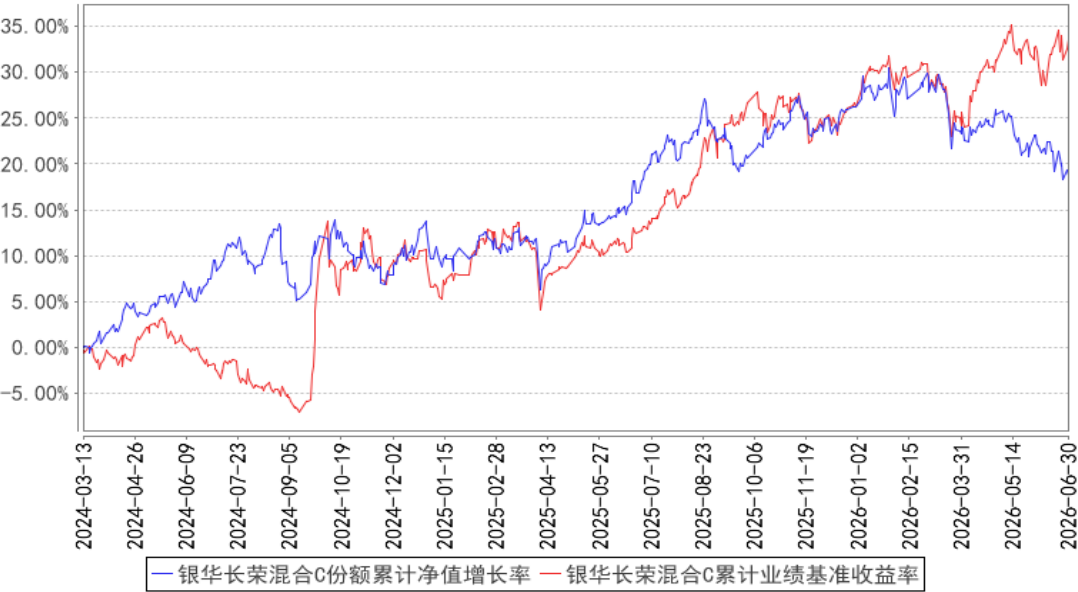
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.64%	0.69%	7.54%	0.88%	-11.18%	-0.19%
过去六个月	-5.85%	0.80%	5.84%	0.83%	-11.69%	-0.03%
过去一年	1.69%	0.71%	18.61%	0.74%	-16.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	18.77%	0.73%	33.58%	0.83%	-14.81%	-0.10%

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

银华长荣混合A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银华长荣混合C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2026 年 6 月底，银华基金管理公募基金 255 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡银玉	本基金的	2021 年 6	-	11 年	博士学位。2014 年 8 月-2015 年 5 月加入

先生	基金经理	月 18 日			光大证券研究所，任医药行业分析师。2015 年 6 月加入银华基金，历任研究部化工行业研究员、大宗组组长、研究主管、投资管理一部投资经理助理、投资经理，现任多元策略投资管理部基金经理/投资经理助理（社保、基本养老保险）/投资经理（社保、基本养老保险）。自 2020 年 4 月 1 日起担任银华长丰混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 18 日起兼任银华长荣混合型证券投资基金基金经理，自 2024 年 3 月 6 日至 2025 年 3 月 25 日兼任银华新材料混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 3 月 13 日起兼任银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
----	------	--------	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期，市场分化较大，市场风格显著偏向以电子为代表的成长类行业，而价值类行业普遍出现持续下跌的走势。成长类行业的强势，主要来自于投资者对 AI 产业未来发展前景的乐观预期，这与前几个季度的情景总体较为类似。

在过去若干个季度，本基金总体致力于价值投资，主要思路是选取一些经营稳定且价值明显的优秀企业。这种选股思路，在过去几个季度尤其是本报告期迎来了较大的挑战，由于 AI 产业的持续爆发，使一批成长股的持续强势表现吸引了大量资金的关注，相应地价值型企业股价普遍表现较弱。在这种背景下，作为普通投资者，我们只能顺应市场，尊重市场，坚守原有投资思路，等待价值回归。

面对分化巨大的市场和净值被动的情况，我们当前主要做的是：在产品净值被动的阶段，尽量控制住净值波动和回撤。因此，在二季度末，我们显著降低了股票仓位。我们仍然坚信价值类品种长期来看能有不错的回报，基金重点持仓行业与前几个季度的差异总体不大，仍然以银行、非银、家电、机械等行业为主，并在重仓品种中新增了面板龙头企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华长荣混合 A 基金份额净值为 1.0785 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.66%；截至本报告期末银华长荣混合 C 基金份额净值为 1.0683 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.85%；业绩比较基准收益率为 5.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们看好宏观经济持续回暖，对全年实现 4.5%~5% 的增长目标抱有充足信心。当前各类政策持续落地，通过发力扩大内需、培育新质生产力、稳定市场预期、化解重点领域风险，将持续巩固经济稳中向好的运行态势。外部环境层面，伴随出口贸易环境逐步改善，外需有望成为拉动经济增长的重要潜在增长点。

资本市场方面，我们判断此前数个季度极致成长风格单边主导的市场格局，或将逐步趋于均衡，价值风格有望重新获得资金关注。经历一段时间的回调与市场冷落后，价值板块的估值、股息率等指标已具备较强配置吸引力。以中证 800 价值指数为例，截至 2026 年 6 月 30 日，其 PE-TTM 市盈率仅为 8.90 倍，PB-LF 仅为 0.87 倍，股息率达 4.52%，对长期投资者而言具备显著的配置价值。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：银华长荣混合型证券投资基金

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	28,693,934.51	31,197,085.39
结算备付金		404,074.20	423,766.83
存出保证金		94,815.07	136,522.95
交易性金融资产	6.4.7.2	140,344,427.24	270,793,995.39
其中：股票投资		140,344,427.24	270,793,995.39
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	18,308,000.00	-
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		7,968,864.90	-
应收股利		-	-
应收申购款		507,643.54	87,911.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		196,321,759.46	302,639,281.78
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		10,933,081.28	29,978.24
应付赎回款		1,741,111.73	5,258,737.93
应付管理人报酬		191,081.24	318,900.51
应付托管费		31,846.86	53,150.09
应付销售服务费		2,485.82	2,435.07
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	239,619.48	321,645.87
负债合计		13,139,226.41	5,984,847.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	169,924,760.87	259,540,408.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	13,257,772.18	37,114,026.04
净资产合计		183,182,533.05	296,654,434.07
负债和净资产总计		196,321,759.46	302,639,281.78

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，银华长荣混合 A 基金份额净值 1.0785 元，基金份额总额 162,365,017.50 份；银华长荣混合 C 基金份额净值 1.0683 元，基金份额总额 7,559,743.37 份。
银华长荣混合份额总额合计为 169,924,760.87 份。

6.2 利润表

会计主体：银华长荣混合型证券投资基金

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		-9,580,080.27	22,442,455.35
1. 利息收入		40,979.25	496,047.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,447.14	129,778.53
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		3,532.11	366,268.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,533,459.39	97,967,748.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,027,848.50	81,555,137.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	-	-
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	2, 505, 610. 89	16, 412, 610. 86
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	-18, 227, 848. 39	-76, 388, 593. 98
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	73, 329. 48	367, 253. 23
减：二、营业总支出		1, 809, 585. 04	5, 207, 632. 24
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 463, 965. 40	4, 253, 369. 56
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	243, 994. 22	708, 894. 91
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	15, 525. 77	137, 411. 57
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	86, 099. 65	107, 956. 20
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-11, 389, 665. 31	17, 234, 823. 11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-11, 389, 665. 31	17, 234, 823. 11
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-11, 389, 665. 31	17, 234, 823. 11

6.3 净资产变动表

会计主体：银华长荣混合型证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	259,540,408.03	-	37,114,026.04	296,654,434.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	259,540,408.03	-	37,114,026.04	296,654,434.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,615,647.16	-	-23,856,253.86	-113,471,901.02
（一）、综合收益总额	-	-	-11,389,665.31	-11,389,665.31
（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）	-89,615,647.16	-	-12,466,588.55	-102,082,235.71
其中：1. 基金申购款	26,243,885.65	-	3,848,970.71	30,092,856.36
2. 基金赎回款	-115,859,532.81	-	-16,315,559.26	-132,175,092.07
（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	169,924,760.87	-	13,257,772.18	183,182,533.05
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	899,345,449.34	-	17,185,896.00	916,531,345.34
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	899,345,449.34	-	17,185,896.00	916,531,345.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-382,694,472.81	-	11,496,255.01	-371,198,217.80
（一）、综合收益总额	-	-	17,234,823.11	17,234,823.11
（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）	-382,694,472.81	-	-5,738,568.10	-388,433,040.91
其中：1.基金申购款	71,377,120.38	-	1,452,698.55	72,829,818.93
2.基金赎回款	-454,071,593.19	-	-7,191,266.65	-461,262,859.84
（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	516,650,976.53	-	28,682,151.01	545,333,127.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

基金管理人负责人

凌宇翔

主管会计工作负责人

伍军辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华长荣混合型证券投资基金(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[2021]746号《关于准予银华长荣混合型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《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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1,565,676,460.65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0610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》于2021年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,565,976,460.66份基金份额,其中认购资金利息折合300,000.01份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华长荣混合型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》,为更好地满足广大投资人的理财需求,本基金管理人经与基金托管人中国招商银行股份有限公司协商一致,决定自2024年3月13日起对本基金增设C类基金份额,据此对本基金的基金合同、托管协议做相应修改。本基金的原有基金份额全部转为A类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板股票、中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、股指期货、国债期货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的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的60%-95%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%)。其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、股指期货等金融工具;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×10%+中证全债指数收益率×30%。

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》、《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 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	28,693,934.51
等于：本金	28,691,803.06
加：应计利息	2,131.45
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	28,693,934.51

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	146,322,033.11	-	140,344,427.24	-5,977,605.87
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	146,322,033.11	-	140,344,427.24	-5,977,605.87

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	18,308,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	18,308,000.00	-

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	534.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	159,741.74
其中：交易所市场	159,741.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	239,619.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华长荣混合 A

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	253,815,409.05	253,815,409.05
本期申购	16,242,988.12	16,242,988.12
本期赎回（以“-”号填列）	-107,693,379.67	-107,693,379.67
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	162,365,017.50	162,365,017.50

银华长荣混合 C

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	5,724,998.98	5,724,998.98
本期申购	10,000,897.53	10,000,897.53
本期赎回（以“-”号填列）	-8,166,153.14	-8,166,153.14
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	7,559,743.37	7,559,743.37

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

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

银华长荣混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,160,090.23	-12,817,222.11	36,342,868.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	49,160,090.23	-12,817,222.11	36,342,868.12
本期利润	6,672,570.72	-17,562,772.72	-10,890,202.00
本期基金份额交易产生的变动数	-19,640,275.27	6,929,102.00	-12,711,173.27
其中：基金申购款	3,418,975.93	-880,456.61	2,538,519.32
基金赎回款	-23,059,251.20	7,809,558.61	-15,249,692.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,192,385.68	-23,450,892.83	12,741,492.85

银华长荣混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,057,481.93	-286,324.01	771,157.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,057,481.93	-286,324.01	771,157.92
本期利润	165,612.36	-665,075.67	-499,463.31
本期基金份额交易产生的变动数	375,172.76	-130,588.04	244,584.72
其中：基金申购款	2,045,694.15	-735,242.76	1,310,451.39
基金赎回款	-1,670,521.39	604,654.72	-1,065,866.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,598,267.05	-1,081,987.72	516,279.33

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	36,082.99
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	1,060.15
其他	304.00
合计	37,447.14

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	6,027,848.50
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	6,027,848.50

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	521,076,487.93
减：卖出股票成本总额	514,315,028.25
减：交易费用	733,611.18
买卖股票差价收入	6,027,848.50

6.4.7.14.3 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	2,505,610.89
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	2,505,610.89

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	-18,227,848.39
股票投资	-18,227,848.39
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	-18,227,848.39

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	68,264.29
基金转换费收入	5,065.19
合计	73,329.48

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	6,752.85
其他	3.64
合计	86,099.65

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
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
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西南证券	139,167,493.38	15.10	98,710,362.70	3.90

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 回购 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（%）
西南证券	-	-	737,597,000.00	27.73

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	62,056.15	15.09	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	44,013.36	3.85	33,978.83	8.62

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,463,965.40	4,253,369.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	638,607.81	1,764,845.83
应支付基金管理人的净管理费	825,357.59	2,488,523.73

注：本基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%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：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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	243,994.22	708,894.91

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 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华长荣混合 A	银华长荣混合 C	合计
银华基金	—	4,527.18	4,527.18
招商银行	—	1,936.92	1,936.92
合计	—	6,464.10	6,464.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华长荣混合 A	银华长荣混合 C	合计
银华基金	—	76,631.18	76,631.18
招商银行	—	6,606.16	6,606.16
合计	—	83,237.34	83,237.34

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给银华基金，再由银华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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	28,693,934.51	36,082.99	42,871,432.60	115,361.11

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

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	104	5,539.04	6,108.96	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	6,083	61,499.13	61,499.13	-
001248	华润新能	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	2,607	26,356.77	26,356.77	-

	源									
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,105	8,641.10	22,917.70	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	98	1,801.24	1,644.44	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	258	7,015.02	8,077.98	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	186	5,650.68	7,252.14	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,038	10,504.56	28,783.74	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	325	4,520.75	10,552.75	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	384	17,694.72	177,918.72	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	412	2,916.96	11,700.80	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	84	4,872.00	9,421.44	-
301682	宏明电	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	233	16,230.78	37,293.98	-

	子	日								
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	59	4,624.42	7,184.43	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	169	4,170.92	14,669.20	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	252	2,817.36	4,432.68	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	48	1,607.52	1,628.64	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	168	2,973.60	14,165.76	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	96	3,934.08	29,586.24	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	177	3,101.04	6,357.84	-
688781	视涯科	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	502	11,385.36	23,900.22	-

	技	日								
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	75	6,913.50	34,736.25	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	83.06	126.45	956	79,405.36	120,886.20	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	1,181	134,964.68	799,466.14	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	81	3,609.36	37,962.27	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	832	87,077.12	639,716.48	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	202	5,308.56	34,762.18	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	119	6,658.05	6,794.90	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	874	8,276.78	61,302.36	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	376	7,399.68	53,200.24	-
920136	永励精	2026年6月25日	1个月内(含)	新股流通受限	19.28	19.28	100	1,928.00	1,928.00	-

	密	日								
920189	康 美 特	2026 年 6 月 30 日	1 个月 内（含）	新股 流通 受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉 和 昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月 内（含）	新股 流通 受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

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

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。

在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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	28,693,934.51	-	-	-	28,693,934.51
结算备付金	404,074.20	-	-	-	404,074.20
存出保证金	94,815.07	-	-	-	94,815.07
交易性金融资产	-	-	-	140,344,427.24	140,344,427.24
买入返售金融资产	18,308,000.00	-	-	-	18,308,000.00
应收申购款	-	-	-	507,643.54	507,643.54
应收清算款	-	-	-	7,968,864.90	7,968,864.90
资产总计	47,500,823.78	-	-	148,820,935.68	196,321,759.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,741,111.73	1,741,111.73
应付管理人报酬	-	-	-	191,081.24	191,081.24
应付托管费	-	-	-	31,846.86	31,846.86
应付清算款	-	-	-	10,933,081.28	10,933,081.28
应付销售服务费	-	-	-	2,485.82	2,485.82
其他负债	-	-	-	239,619.48	239,619.48
负债总计	-	-	-	13,139,226.41	13,139,226.41
利率敏感度缺口	47,500,823.78	-	-	135,681,709.27	183,182,533.05
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	31,197,085.39	-	-	-	31,197,085.39

结算备付金	423,766.83	-	-	-	423,766.83
存出保证金	136,522.95	-	-	-	136,522.95
交易性金融资产	-	-	-	-270,793,995.39	270,793,995.39
应收申购款	-	-	-	87,911.22	87,911.22
资产总计	31,757,375.17	-	-	-270,881,906.61	302,639,281.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,258,737.93	5,258,737.93
应付管理人报酬	-	-	-	318,900.51	318,900.51
应付托管费	-	-	-	53,150.09	53,150.09
应付清算款	-	-	-	29,978.24	29,978.24
应付销售服务费	-	-	-	2,435.07	2,435.07
其他负债	-	-	-	321,645.87	321,645.87
负债总计	-	-	-	5,984,847.71	5,984,847.71
利率敏感度缺口	31,757,375.17	-	-	-264,897,058.90	296,654,434.07

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	-	238,953.75	-	238,953.75
资产合计	-	238,953.75	-	238,953.75
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	-	238,953.75	-	238,953.75
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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

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%	-11,947.69	0.00
	港币 5%	11,947.69	0.00

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	140,344,427.24	76.61	270,793,995.39	91.28
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	140,344,427.24	76.61	270,793,995.39	91.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,759,069.95	9,941,310.11
	业绩比较基准下降 5%	-5,759,069.95	-9,941,310.11

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	137,979,745.42	268,577,850.99
第二层次	93,967.90	-
第三层次	2,270,713.92	2,216,144.40
合计	140,344,427.24	270,793,995.39

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	140,344,427.24	71.49
	其中：股票	140,344,427.24	71.49

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	18,308,000.00	9.33
	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	29,098,008.71	14.82
8	其他各项资产	8,571,323.51	4.37
9	合计	196,321,759.46	100.00

注：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 238,953.75 元，占期末净值比例为 0.13%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,050,137.00	0.57
B	采矿业	9,074,113.64	4.95
C	制造业	54,323,639.79	29.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,211,080.90	3.94
E	建筑业	4,490,080.00	2.45
F	批发和零售业	550,822.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	6,359,134.46	3.47
H	住宿和餐饮业	13,104.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,296,461.00	0.71
J	金融业	52,881,280.52	28.87
K	房地产业	1,090,077.00	0.60
L	租赁和商务服务业	1,329,649.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	37,612.18	0.02
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	29,376.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	368,906.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	140,105,473.49	76.48

7.2.2 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	-	-
消费者非必需品	29,747.84	0.02
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	22,554.51	0.01
电信服务	186,651.40	0.10
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	238,953.75	0.13

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

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	601318	中国平安	132,800	6,339,872.00	3.46
2	000333	美的集团	82,500	6,231,225.00	3.40
3	000725	京东方 A	694,800	6,030,864.00	3.29
4	600030	中信证券	155,425	4,465,360.25	2.44
5	688009	中国通号	835,724	3,978,046.24	2.17
6	601398	工商银行	476,001	3,365,327.07	1.84
7	601166	兴业银行	196,100	3,247,416.00	1.77
8	000651	格力电器	78,800	2,955,000.00	1.61
9	000100	TCL 科技	504,600	2,936,772.00	1.60
10	601328	交通银行	441,300	2,837,559.00	1.55
11	000623	吉林敖东	136,900	2,427,237.00	1.33
12	601857	中国石油	249,000	2,161,320.00	1.18
13	600919	江苏银行	182,200	1,964,116.00	1.07
14	000001	平安银行	176,100	1,769,805.00	0.97
15	601088	中国神华	44,688	1,744,619.52	0.95
16	002142	宁波银行	58,242	1,729,204.98	0.94
17	003816	中国广核	432,400	1,690,684.00	0.92
18	601211	国泰海通	91,500	1,665,300.00	0.91
19	600887	伊利股份	68,100	1,631,676.00	0.89
20	002475	立讯精密	23,100	1,626,240.00	0.89
21	002966	苏州银行	233,300	1,623,768.00	0.89
22	600016	民生银行	448,200	1,443,204.00	0.79
23	000776	广发证券	60,800	1,422,720.00	0.78
24	000338	潍柴动力	51,300	1,397,925.00	0.76
25	000429	粤高速 A	93,700	1,279,005.00	0.70
26	601988	中国银行	216,000	1,235,520.00	0.67

27	601601	中国太保	43,000	1,226,360.00	0.67
28	002352	顺丰控股	38,200	1,194,132.00	0.65
29	601985	中国核电	131,200	1,184,736.00	0.65
30	601668	中国建筑	271,200	1,177,008.00	0.64
31	002807	江阴银行	317,213	1,176,860.23	0.64
32	002958	青农商行	417,400	1,143,676.00	0.62
33	000166	申万宏源	253,800	1,116,720.00	0.61
34	600926	杭州银行	76,300	1,102,535.00	0.60
35	688795	摩尔线程	1,547	1,061,701.48	0.58
36	601225	陕西煤业	51,800	1,054,130.00	0.58
37	002714	牧原股份	29,900	1,046,201.00	0.57
38	601939	建设银行	107,500	1,035,225.00	0.57
39	000425	徐工机械	126,500	1,023,385.00	0.56
40	600999	招商证券	47,000	991,700.00	0.54
41	601919	中远海控	71,600	949,416.00	0.52
42	601818	光大银行	312,600	903,414.00	0.49
43	002027	分众传媒	171,000	827,640.00	0.45
44	600938	中国海油	30,200	819,930.00	0.45
45	601658	邮储银行	164,000	808,520.00	0.44
46	000807	云铝股份	36,500	808,110.00	0.44
47	002001	新 和 成	28,100	798,602.00	0.44
48	600000	浦发银行	90,500	779,205.00	0.43
49	002648	卫星化学	33,100	777,519.00	0.42
50	601916	浙商银行	278,600	732,718.00	0.40
51	002926	华西证券	86,400	705,888.00	0.39
52	601006	大秦铁路	147,900	681,819.00	0.37
53	000783	长江证券	68,600	668,850.00	0.37
54	688802	沐曦股份	832	639,716.48	0.35
55	600690	海尔智家	30,600	624,546.00	0.34
56	002736	国信证券	62,300	622,377.00	0.34
57	600886	国投电力	44,100	586,971.00	0.32
58	002236	大华股份	34,000	560,660.00	0.31
59	001979	招商蛇口	86,000	552,980.00	0.30
60	688120	华海清科	1,709	550,605.62	0.30
61	601868	中国能建	204,600	546,282.00	0.30
62	601390	中国中铁	129,700	540,849.00	0.30
63	688786	悦安新材	11,591	534,113.28	0.29
64	600011	华能国际	67,700	513,843.00	0.28
65	601077	渝农商行	83,300	508,963.00	0.28
66	600188	兖矿能源	28,300	502,891.00	0.27
67	601186	中国铁建	84,300	501,585.00	0.27
68	000883	湖北能源	113,400	489,888.00	0.27
69	000157	中联重科	68,600	478,142.00	0.26

70	601958	金钼股份	16,800	472,248.00	0.26
71	600585	海螺水泥	27,700	469,515.00	0.26
72	600941	中国移动	5,400	465,102.00	0.25
73	002601	龙佰集团	28,200	464,736.00	0.25
74	000895	双汇发展	20,500	459,200.00	0.25
75	603156	养元饮品	8,900	436,723.00	0.24
76	601108	财通证券	50,100	433,365.00	0.24
77	601669	中国电建	92,100	432,870.00	0.24
78	002673	西部证券	66,300	430,287.00	0.23
79	601898	中煤能源	35,099	427,505.82	0.23
80	002831	裕同科技	11,916	423,732.96	0.23
81	300395	菲利华	3,100	414,563.00	0.23
82	688375	国博电子	3,928	409,690.40	0.22
83	600015	华夏银行	63,800	407,682.00	0.22
84	601881	中国银河	32,400	407,268.00	0.22
85	601577	长沙银行	46,700	406,757.00	0.22
86	601377	兴业证券	66,200	399,848.00	0.22
87	000728	国元证券	51,410	385,060.90	0.21
88	600066	宇通客车	14,300	383,383.00	0.21
89	002056	横店东磁	12,500	381,000.00	0.21
90	002939	长城证券	45,400	378,636.00	0.21
91	600141	兴发集团	8,000	375,760.00	0.21
92	600048	保利发展	81,000	375,030.00	0.20
93	601198	东兴证券	27,400	372,366.00	0.20
94	600918	中泰证券	66,600	354,312.00	0.19
95	001965	招商公路	37,900	347,164.00	0.19
96	000786	北新建材	19,100	345,519.00	0.19
97	300866	安克创新	3,300	344,850.00	0.19
98	600026	中远海能	19,000	340,860.00	0.19
99	002078	太阳纸业	27,200	339,728.00	0.19
100	000983	山西焦煤	58,000	336,400.00	0.18
101	688385	复旦微电	4,659	332,140.11	0.18
102	002060	广东建工	108,000	327,240.00	0.18
103	002064	华峰化学	34,100	323,609.00	0.18
104	601838	成都银行	17,800	315,060.00	0.17
105	600028	中国石化	69,800	311,308.00	0.17
106	601555	东吴证券	39,300	311,256.00	0.17
107	605090	九丰能源	8,200	304,794.00	0.17
108	600637	东方明珠	36,500	303,315.00	0.17
109	688041	海光信息	800	296,240.00	0.16
110	002532	天山铝业	27,600	296,148.00	0.16
111	601665	齐鲁银行	50,700	292,539.00	0.16
112	688318	财富趋势	4,100	292,371.00	0.16

113	000951	中国重汽	14,400	280,944.00	0.15
114	000021	深科技	4,300	276,361.00	0.15
115	688475	萤石网络	10,061	275,168.35	0.15
116	000683	博源化工	46,300	266,688.00	0.15
117	600177	雅戈尔	35,300	265,809.00	0.15
118	600039	四川路桥	33,900	265,098.00	0.14
119	600582	天地科技	58,400	259,880.00	0.14
120	600153	建发股份	32,100	254,553.00	0.14
121	000415	渤海租赁	60,800	247,456.00	0.14
122	000039	中集集团	30,400	246,544.00	0.13
123	600219	南山铝业	61,500	245,385.00	0.13
124	600060	海信视像	8,600	239,682.00	0.13
125	000708	中信特钢	18,900	238,518.00	0.13
126	000921	海信家电	8,600	234,952.00	0.13
127	600329	达仁堂	6,300	234,486.00	0.13
128	000830	鲁西化工	19,500	234,000.00	0.13
129	688220	翱捷科技	1,880	233,721.60	0.13
130	600499	科达制造	16,900	233,220.00	0.13
131	688396	华润微	2,351	229,340.05	0.13
132	601618	中国中冶	92,100	224,724.00	0.12
133	601216	君正集团	50,300	224,338.00	0.12
134	601666	平煤股份	31,100	222,365.00	0.12
135	300782	卓胜微	2,000	219,160.00	0.12
136	000591	太阳能	47,400	218,040.00	0.12
137	600348	华阳股份	28,200	215,730.00	0.12
138	601018	宁波港	68,000	214,200.00	0.12
139	000513	丽珠集团	7,400	213,786.00	0.12
140	301308	江波龙	300	211,140.00	0.12
141	601998	中信银行	30,000	207,900.00	0.11
142	002587	奥拓电子	26,000	203,060.00	0.11
143	002120	韵达股份	31,900	202,884.00	0.11
144	600998	九州通	43,000	201,670.00	0.11
145	600282	南钢股份	43,900	201,501.00	0.11
146	601600	中国铝业	24,200	198,924.00	0.11
147	600170	上海建工	88,700	196,914.00	0.11
148	600023	浙能电力	37,400	196,724.00	0.11
149	688008	澜起科技	623	193,067.70	0.11
150	002233	塔牌集团	27,200	189,584.00	0.10
151	600109	国金证券	21,400	187,892.00	0.10
152	600483	福能股份	18,400	187,496.00	0.10
153	00700	腾讯控股	500	186,651.40	0.10
154	601019	山东出版	28,800	184,320.00	0.10
155	688778	厦钨新能	3,383	184,035.20	0.10

156	600535	天士力	13,900	183,897.00	0.10
157	600027	华电国际	41,100	182,895.00	0.10
158	000582	北部湾港	16,800	180,264.00	0.10
159	601877	正泰电器	7,100	177,997.00	0.10
160	002241	歌尔股份	7,900	177,987.00	0.10
161	301666	大普微	384	177,918.72	0.10
162	000598	兴蓉环境	27,400	175,908.00	0.10
163	300476	胜宏科技	500	173,215.00	0.09
164	300115	长盈精密	6,100	170,434.00	0.09
165	600704	物产中大	36,100	170,392.00	0.09
166	600061	国投资本	25,700	168,335.00	0.09
167	002299	圣农发展	11,100	168,276.00	0.09
168	600008	首创环保	60,900	165,648.00	0.09
169	601991	大唐发电	23,200	164,256.00	0.09
170	601000	唐山港	38,800	161,020.00	0.09
171	601825	沪农商行	21,300	159,537.00	0.09
172	600985	淮北矿业	11,300	158,765.00	0.09
173	601156	东航物流	9,700	156,364.00	0.09
174	600820	隧道股份	30,000	156,300.00	0.09
175	002244	滨江集团	20,200	153,520.00	0.08
176	000959	首钢股份	43,600	153,036.00	0.08
177	601016	节能风电	38,700	150,156.00	0.08
178	601699	潞安环能	10,100	144,228.00	0.08
179	688249	晶合集成	2,400	141,672.00	0.08
180	601001	晋控煤业	8,100	140,859.00	0.08
181	600398	海澜之家	26,900	140,687.00	0.08
182	000709	河钢股份	70,700	137,158.00	0.07
183	600377	宁沪高速	11,800	136,526.00	0.07
184	601866	中远海发	61,600	136,136.00	0.07
185	600873	梅花生物	18,400	135,240.00	0.07
186	600642	申能股份	15,300	133,569.00	0.07
187	600566	济川药业	6,000	133,140.00	0.07
188	002508	老板电器	9,000	131,580.00	0.07
189	600546	山煤国际	11,900	130,067.00	0.07
190	000932	华菱钢铁	37,000	128,390.00	0.07
191	600970	中材国际	17,000	121,210.00	0.07
192	688790	昂瑞微	956	120,886.20	0.07
193	600863	华能蒙电	25,000	117,500.00	0.06
194	600098	广州发展	19,700	116,427.00	0.06
195	601298	青岛港	14,400	115,920.00	0.06
196	688729	屹唐股份	2,669	114,767.00	0.06
197	000537	绿发电力	15,600	114,036.00	0.06
198	600295	鄂尔多斯	10,200	109,344.00	0.06

199	603444	吉比特	300	107,526.00	0.06
200	600737	中粮糖业	8,700	107,271.00	0.06
201	601187	厦门银行	15,100	103,133.00	0.06
202	601997	贵阳银行	20,000	102,600.00	0.06
203	300223	君正股份	400	99,560.00	0.05
204	688819	天能股份	4,482	99,500.40	0.05
205	600511	国药股份	3,800	98,952.00	0.05
206	000937	冀中能源	24,090	95,878.20	0.05
207	002608	江苏国信	13,700	94,530.00	0.05
208	601139	深圳燃气	16,600	93,956.00	0.05
209	603565	中谷物流	9,300	91,233.00	0.05
210	601928	凤凰传媒	10,200	89,658.00	0.05
211	001248	华润新能源	8,690	87,855.90	0.05
212	000778	新兴铸管	23,100	85,701.00	0.05
213	600928	西安银行	24,800	81,096.00	0.04
214	600968	海油发展	24,000	79,920.00	0.04
215	000539	粤电力 A	11,700	79,677.00	0.04
216	601598	中国外运	15,900	78,864.00	0.04
217	600019	宝钢股份	14,500	78,735.00	0.04
218	603816	顾家家居	3,500	78,260.00	0.04
219	600909	华安证券	7,000	77,770.00	0.04
220	000650	仁和药业	14,500	73,805.00	0.04
221	000401	金隅冀东	21,700	72,478.00	0.04
222	601128	常熟银行	12,342	71,830.44	0.04
223	001286	陕西能源	6,900	69,966.00	0.04
224	688362	甬矽电子	667	64,298.80	0.04
225	600803	新奥股份	4,000	63,200.00	0.03
226	688818	电科蓝天	874	61,302.36	0.03
227	600908	无锡银行	11,800	59,944.00	0.03
228	688809	强一股份	92	57,316.00	0.03
229	688759	必贝特	1,724	55,133.52	0.03
230	688820	盛合晶微	376	53,200.24	0.03
231	300836	佰奥智能	700	51,793.00	0.03
232	600373	中文传媒	7,100	47,073.00	0.03
233	002839	张家港行	10,511	40,992.90	0.02
234	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.02
235	688797	臻宝科技	81	37,962.27	0.02
236	301682	宏明电子	233	37,293.98	0.02
237	688813	泰金新能	202	34,762.18	0.02
238	688785	恒运昌	75	34,736.25	0.02
239	002867	周大生	3,100	34,565.00	0.02
240	601963	重庆银行	3,300	33,264.00	0.02
241	001872	招商港口	1,600	31,088.00	0.02

242	002152	广电运通	3,200	30,016.00	0.02
243	688796	百奥赛图	273	29,866.20	0.02
244	300146	汤臣倍健	3,300	29,832.00	0.02
245	03690	美团-W	500	29,747.84	0.02
246	688635	长进光子	96	29,586.24	0.02
247	300192	科德教育	1,800	29,376.00	0.02
248	001399	惠科股份	1,038	28,783.74	0.02
249	000875	电投绿能	5,500	28,325.00	0.02
250	300724	捷佳伟创	400	28,240.00	0.02
251	601518	吉林高速	10,000	28,000.00	0.02
252	300364	中文在线	1,100	25,949.00	0.01
253	603093	南华期货	1,400	25,410.00	0.01
254	300770	新媒股份	800	25,192.00	0.01
255	300618	寒锐钴业	700	24,990.00	0.01
256	688192	迪哲医药	625	24,956.25	0.01
257	000825	太钢不锈	7,300	24,893.00	0.01
258	688781	视涯科技	502	23,900.22	0.01
259	002385	大北农	8,600	23,736.00	0.01
260	001257	盛龙股份	1,105	22,917.70	0.01
261	688349	三一重能	1,491	22,633.38	0.01
262	01810	小米集团-W	1,200	22,554.51	0.01
263	000089	深圳机场	3,600	21,708.00	0.01
264	600732	爱旭股份	1,500	20,775.00	0.01
265	002092	中泰化学	5,400	20,682.00	0.01
266	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.01
267	688811	有研新材	834	20,124.42	0.01
268	002517	恺英网络	1,200	19,500.00	0.01
269	600955	维远股份	1,300	19,136.00	0.01
270	000949	新乡化纤	3,000	19,020.00	0.01
271	600801	华新建材	1,200	18,720.00	0.01
272	600210	紫江企业	3,000	18,600.00	0.01
273	600583	海油工程	3,400	17,102.00	0.01
274	002180	奔图科技	1,000	16,360.00	0.01
275	603328	依顿电子	1,300	16,289.00	0.01
276	600075	新疆天业	4,000	16,160.00	0.01
277	002025	航天电器	200	15,244.00	0.01
278	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
279	600739	辽宁成大	1,500	15,165.00	0.01
280	603175	超颖电子	169	15,056.21	0.01
281	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
282	301696	三瑞智能	169	14,669.20	0.01
283	600507	方大特钢	3,500	14,175.00	0.01
284	603459	红板科技	168	14,165.76	0.01

285	603690	至纯科技	400	14,160.00	0.01
286	000156	华数传媒	2,200	13,882.00	0.01
287	600390	五矿资本	2,900	13,224.00	0.01
288	301299	卓创资讯	300	13,218.00	0.01
289	002563	森马服饰	2,600	13,104.00	0.01
289	600258	首旅酒店	1,200	13,104.00	0.01
290	002605	姚记科技	700	12,789.00	0.01
291	301669	高特电子	412	11,700.80	0.01
292	688569	铁科轨道	723	11,676.45	0.01
293	601568	北元化工	3,400	11,560.00	0.01
294	002739	儒意电影	1,200	11,520.00	0.01
295	600655	豫园股份	2,700	11,097.00	0.01
296	600033	福建高速	3,400	10,948.00	0.01
297	688116	天奈科技	278	10,619.60	0.01
298	301599	理奇智能	325	10,552.75	0.01
299	600155	华创云信	1,900	10,488.00	0.01
300	600409	三友化工	1,700	10,387.00	0.01
301	601858	中国科传	600	10,386.00	0.01
302	600782	新钢股份	4,100	10,168.00	0.01
303	300073	当升科技	200	9,608.00	0.01
304	002588	史丹利	1,200	9,480.00	0.01
305	301680	固德电材	84	9,421.44	0.01
306	600325	华发股份	3,700	8,547.00	0.00
307	300494	盛天网络	1,000	8,430.00	0.00
308	600508	上海能源	1,120	8,254.40	0.00
309	001365	天海电子	258	8,077.98	0.00
310	000917	电广传媒	1,200	8,028.00	0.00
311	600339	中油工程	2,500	7,675.00	0.00
312	300067	安诺其	1,400	7,588.00	0.00
313	600859	王府井	800	7,344.00	0.00
314	001393	维通利	186	7,252.14	0.00
315	301683	慧谷新材	59	7,184.43	0.00
316	688816	易思维	119	6,794.90	0.00
317	001369	双欣材料	488	6,597.76	0.00
318	603883	老百姓	600	6,576.00	0.00
319	002572	索菲亚	900	6,570.00	0.00
320	600987	航民股份	1,085	6,564.25	0.00
321	002410	广联达	800	6,528.00	0.00
322	600230	沧州大化	500	6,510.00	0.00
323	001221	悍高集团	160	6,435.20	0.00
324	688712	北芯生命	177	6,357.84	0.00
325	001237	惠康科技	104	6,108.96	0.00
326	002936	郑州银行	3,700	6,105.00	0.00

327	600720	中交设计	1,100	5,302.00	0.00
328	600528	中铁工业	800	5,272.00	0.00
329	603323	苏农银行	1,320	5,108.40	0.00
330	002091	江苏国泰	700	5,061.00	0.00
331	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
332	601112	振石股份	252	4,432.68	0.00
333	601118	海南橡胶	800	3,936.00	0.00
334	603370	华新精科	82	2,950.36	0.00
335	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
336	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
337	920136	永励精密	100	1,928.00	0.00
338	001312	福恩股份	98	1,644.44	0.00
339	603293	埃泰克	48	1,628.64	0.00
340	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
341	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
342	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
343	601288	农业银行	5	30.35	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	601857	中国石油	8,952,563.00	3.02
2	601088	中国神华	8,438,036.08	2.84
3	601988	中国银行	7,072,059.00	2.38
4	600938	中国海油	5,816,650.00	1.96
4	00883	中国海洋石油	1,249,669.87	0.42
5	601398	工商银行	6,608,327.00	2.23
6	601288	农业银行	6,253,282.00	2.11
7	600900	长江电力	5,466,808.00	1.84
8	000333	美的集团	5,448,575.00	1.84
9	601600	中国铝业	5,439,503.00	1.83
10	600000	浦发银行	5,332,979.00	1.80
11	600519	贵州茅台	5,113,077.95	1.72
12	300059	东方财富	5,091,579.00	1.72
13	601009	南京银行	5,081,897.00	1.71
14	002807	江阴银行	4,912,701.00	1.66
15	601328	交通银行	4,882,462.00	1.65
16	603993	洛阳钼业	4,834,691.00	1.63
17	600919	江苏银行	4,538,424.00	1.53
18	601166	兴业银行	4,221,821.00	1.42
19	601211	国泰海通	4,171,011.00	1.41
20	000651	格力电器	4,162,112.00	1.40

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	601398	工商银行	10,188,943.00	3.43
2	601088	中国神华	9,772,946.50	3.29
3	601288	农业银行	9,620,659.00	3.24
4	601857	中国石油	9,232,963.00	3.11
5	601988	中国银行	9,158,622.56	3.09
6	601318	中国平安	8,796,958.00	2.97
7	601166	兴业银行	8,721,687.00	2.94
8	000333	美的集团	7,942,876.20	2.68
9	600938	中国海油	6,493,047.00	2.19
9	00883	中国海洋石油	1,213,899.35	0.41
10	601009	南京银行	7,318,207.00	2.47
11	601211	国泰海通	7,180,796.25	2.42
12	600000	浦发银行	6,883,884.00	2.32
13	000651	格力电器	6,206,503.98	2.09
14	603993	洛阳钼业	6,106,237.00	2.06
15	002601	龙佰集团	5,743,629.00	1.94
16	601328	交通银行	5,670,916.00	1.91
17	601169	北京银行	5,538,811.00	1.87
18	600900	长江电力	5,478,915.00	1.85
19	601229	上海银行	5,269,847.20	1.78
20	600089	特变电工	5,232,495.00	1.76

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	402,093,308.49
卖出股票收入（成交）总额	521,076,487.93

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	94,815.07
2	应收清算款	7,968,864.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	507,643.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,571,323.51

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
银华长荣 混合 A	6,473	25,083.43	2,111,983.64	1.30	160,253,033.86	98.70
银华长荣 混合 C	6,577	1,149.42	4,044,680.94	53.50	3,515,062.43	46.50
合计	13,050	13,021.05	6,156,664.58	3.62	163,768,096.29	96.38

注：对于分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算当中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	81.68

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华长荣混合 A	1,207,593.71	0.74
	银华长荣混合 C	64.87	0.00
	合计	1,207,658.58	0.71

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华长荣混合 A	—
	银华长荣混合 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	银华长荣混合 A	50~100
	银华长荣混合 C	—

	合计	50~100
--	----	--------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华长荣混合 A	银华长荣混合 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 18 日）基金份额总额	1, 565, 976, 460. 66	—
本报告期期初基金份额总额	253, 815, 409. 05	5, 724, 998. 98
本报告期基金总申购份额	16, 242, 988. 12	10, 000, 897. 53
减：本报告期基金总赎回份额	107, 693, 379. 67	8, 166, 153. 14
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	162, 365, 017. 50	7, 559, 743. 37

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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(%)	
华泰证券	6	230,470,111.52	25.00	102,765.73	24.99	—
国信证券	2	157,195,890.20	17.05	70,099.24	17.05	—
西南证券	4	139,167,493.38	15.10	62,056.15	15.09	—
中金公司	4	94,556,804.35	10.26	42,160.47	10.25	—
东吴证券	2	81,538,838.51	8.84	36,358.02	8.84	—
国泰海通	3	71,925,042.43	7.80	32,071.17	7.80	—
华西证券	4	60,382,360.61	6.55	26,920.96	6.55	—
天风证券	2	41,049,956.59	4.45	18,303.57	4.45	—
中信证券	3	27,544,579.29	2.99	12,412.76	3.02	—
广发证券	6	9,166,300.04	0.99	4,087.37	0.99	—
国投证券	2	5,070,727.00	0.55	2,261.12	0.55	—
华源证券	2	3,178,289.40	0.34	1,417.60	0.34	新增2个交易单元
中信建投	2	678,864.71	0.07	339.43	0.08	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	4	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—

光大证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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(%)
华泰证券	-	-	4,568,000.00	4.45	-	-
国信证券	-	-	32,971,000.00	32.13	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	23,692,000.00	23.09	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	41,376,000.00	40.32	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	《银华长荣混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于银华旗下部分基金接受代销机构费率折扣申请的公告》	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 2 月 3 日
4	《银华长荣混合型证券投资基金 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
5	《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
6	《银华长荣混合型证券投资基金 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

7	《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
---	--	-------	-----------------

§ 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 银华长荣混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华长荣混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华长荣混合型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