

银华中证 500 价值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	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	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
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	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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	40
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	40
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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	43
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	43
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	500 价值
场内简称	500 价值（扩位证券简称：中证 500 价值 ETF 银华）
基金主代码	562330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 7 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	10,018,919.00 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	2023 年 4 月 18 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。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金标的指数为中证 500 价值指数。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 500 价值指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张姗
	联系电话	(010) 58163000	400-61-95555
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	400-61-95555
传真		(010) 58163027	0755-83195201

注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100738	518040
法定代表人	王珠林	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告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	3,626,439.85
本期利润	1,694,417.07
加权平均基金份额本期利润	0.1124
本期加权平均净值利润率	8.73%
本期基金份额净值增长率	1.62%
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	2,111,963.62
期末可供分配基金份额利润	0.2108
期末基金资产净值	12,130,882.62
期末基金份额净值	1.2108
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	21.08%

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。

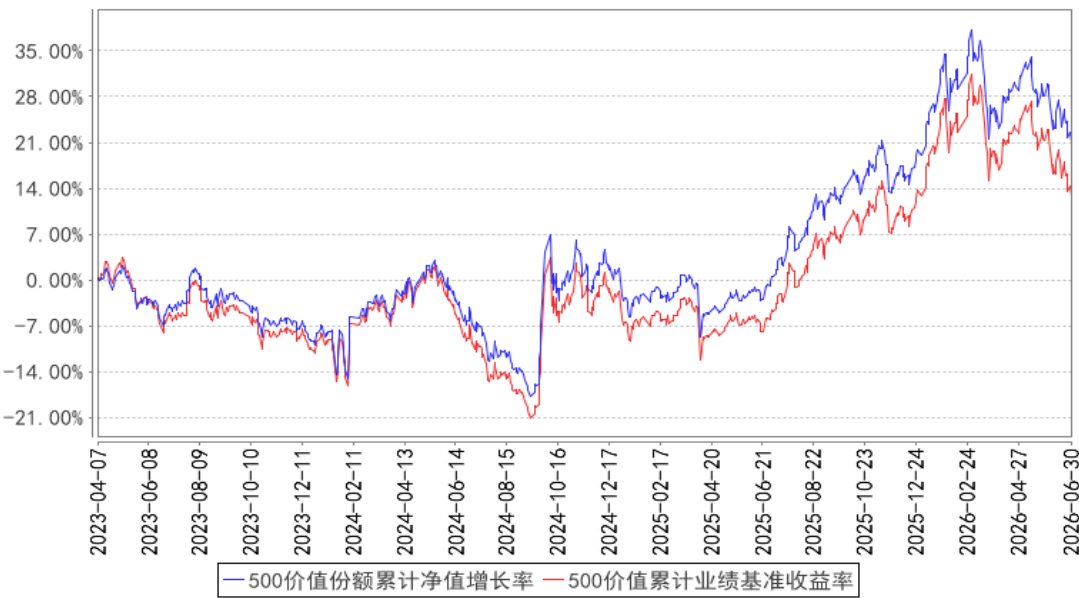
3.2 基金净值表现

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	-2.58%	1.16%	-4.23%	1.18%	1.65%	-0.02%
过去六个月	1.62%	1.33%	0.01%	1.36%	1.61%	-0.03%
过去一年	22.27%	1.12%	20.21%	1.15%	2.06%	-0.03%
过去三年	26.94%	1.17%	20.02%	1.20%	6.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	21.08%	1.14%	12.90%	1.17%	8.18%	-0.03%

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

500价值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		
马君女士	本基金的基金经理	2023 年 4 月 7 日	-	17.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日至 2024 年 9 月 26 日兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式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联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 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 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 2022 年 4 月 20 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发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日至 2025 年 7 月 11 日兼任银华中证基建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 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 4 月 25 日至 2025 年 8 月 27 日兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 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 16 日起兼任银华国证港股通创新药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 4 月 29 日起兼任银华中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张卓希女士	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 22 日	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永（中国）企业咨询有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
郭九良先生	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将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 1.2108 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.62%，业绩比较基准收益率为 0.01%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 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验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 11 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。自 2024 年 9 月 26 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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 500 价值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	252, 733. 60	526, 791. 63
结算备付金		14, 497. 83	17, 175. 17
存出保证金		6, 891. 33	6, 176. 23
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	11, 863, 555. 59	22, 121, 424. 46
其中：股票投资		11, 863, 555. 59	22, 121, 424. 46
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	—	—
债权投资	6. 4. 7. 5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6. 4. 7. 6	—	—
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	900. 00	1, 845. 00
资产总计		12, 138, 578. 35	22, 673, 412. 49
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		—	19. 74
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		5, 156. 32	8, 906. 18
应付托管费		1, 031. 29	1, 781. 27
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	1,508.12	1,825.28
负债合计		7,695.73	12,532.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	10,018,919.00	19,018,919.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,111,963.62	3,641,961.02
净资产合计		12,130,882.62	22,660,880.02
负债和净资产总计		12,138,578.35	22,673,412.49

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2108 元，基金份额总额 10,018,919.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 500 价值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		1,752,435.83	42,876.61
1. 利息收入		883.56	1,370.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	883.56	1,370.10
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）		3,683,668.19	166,072.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,485,147.75	-112,747.25
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	198,520.44	278,819.35
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	-1,932,022.78	-150,675.89

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	-93.14	26,110.30
减：二、营业总支出		58,018.76	48,686.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	48,349.00	40,572.34
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,669.76	8,114.49
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	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,694,417.07	-5,810.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,694,417.07	-5,810.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,694,417.07	-5,810.22

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 500 价值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	19,018,919.00	-	3,641,961.02	22,660,880.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,018,919.00	-	3,641,961.02	22,660,880.02
三、本期增减变	-9,000,000.00	-	-1,529,997.40	-10,529,997.40

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	1,694,417.07	1,694,417.07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-9,000,000.00	-	-3,224,414.47	-12,224,414.47
其中：1. 基金申购款	16,000,000.00	-	4,148,421.79	20,148,421.79
2. 基金赎回款	-25,000,000.00	-	-7,372,836.26	-32,372,836.26
（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	10,018,919.00	-	2,111,963.62	12,130,882.62
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	19,018,919.00	-	-24,772.04	18,994,146.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,018,919.00	-	-24,772.04	18,994,146.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-120,780.37	-4,120,780.37
（一）、综合收益总额	-	-	-5,810.22	-5,810.22

(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)	-4,000,000.00	-	-114,970.15	-4,114,970.15
其中:1.基金申购款	16,000,000.00	-	-515,124.60	15,484,875.40
2.基金赎回款	-20,000,000.00	-	400,154.45	-19,599,845.55
(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	15,018,919.00	-	-145,552.41	14,873,366.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证 500 价值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[2022]3021 号《关于准予银华中证 500 价值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 500 价值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 585,018,919.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0196 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份

额总额为 585,018,919.00 份基金份额，不含认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2023]75 号核准，本基金 585,018,919.00 份基金份额于 2023 年 4 月 18 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 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转换公司债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金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 500 价值指数收益率。

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 500 价值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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	252,733.60
等于：本金	252,704.63
加：应计利息	28.97
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	252,733.60

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	12,398,768.49	-	11,863,555.59	-535,212.90
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	12,398,768.49	-	11,863,555.59	-535,212.90

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	900.00
待摊费用	-
合计	900.00

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	1,508.12
其中：交易所市场	1,508.12
银行间市场	-
应付利息	-
合计	1,508.12

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	19,018,919.00	19,018,919.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,000,000.00	-25,000,000.00

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	10,018,919.00	10,018,919.00

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	3,042,518.05	599,442.97	3,641,961.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,042,518.05	599,442.97	3,641,961.02
本期利润	3,626,439.85	-1,932,022.78	1,694,417.07
本期基金份额交易产生的变动数	-2,739,899.29	-484,515.18	-3,224,414.47
其中：基金申购款	3,083,977.31	1,064,444.48	4,148,421.79
基金赎回款	-5,823,876.60	-1,548,959.66	-7,372,836.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,929,058.61	-1,817,094.99	2,111,963.62

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	820.53
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	50.31
其他	12.72
合计	883.56

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	2,187,918.45
股票投资收益——赎回差价收入	1,297,229.30

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	3,485,147.75

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	16,985,149.02
减：卖出股票成本总额	14,782,552.02
减：交易费用	14,678.55
买卖股票差价收入	2,187,918.45

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	32,372,836.26
减：现金支付赎回款总额	13,375,280.26
减：赎回股票成本总额	17,700,326.70
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,297,229.30

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	198,520.44
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	198,520.44

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	-1,932,022.78
股票投资	-1,932,022.78

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	-1,932,022.78

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	-93.14
合计	-93.14

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

注：无。

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	基金管理人

金”)	
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	48,349.00	40,572.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,060.74	6,032.82
应支付基金管理人的净管理费	35,288.26	34,539.52

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	9,669.76	8,114.49

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	252,733.60	820.53	793,511.28	1,312.41

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

1，本基金本报告期末投资于基金管理人股东（西南证券股份有限公司）发行的股票：西南证券（代码 600369）22,700.00 股，期末公允价值为人民币 91,254.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.75%。

2, 自 2024 年 9 月 26 日起, 由本基金管理人承担本基金的固定费用。

6.4.11 利润分配情况

注: 无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: 无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

险进行管理。

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	252,733.60	-	-	-	252,733.60
结算备付金	14,497.83	-	-	-	14,497.83
存出保证金	6,891.33	-	-	-	6,891.33
交易性金融资产	-	-	-	11,863,555.59	11,863,555.59
其他资产	-	-	-	900.00	900.00
资产总计	274,122.76	-	-	11,864,455.59	12,138,578.35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,156.32	5,156.32
应付托管费	-	-	-	1,031.29	1,031.29
其他负债	-	-	-	1,508.12	1,508.12
负债总计	-	-	-	7,695.73	7,695.73
利率敏感度缺口	274,122.76	-	-	11,856,759.86	12,130,882.62
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	526,791.63	-	-	-	526,791.63
结算备付金	17,175.17	-	-	-	17,175.17
存出保证金	6,176.23	-	-	-	6,176.23
交易性金融资产	-	-	-	22,121,424.46	22,121,424.46
其他资产	-	-	-	1,845.00	1,845.00
资产总计	550,143.03	-	-	22,123,269.46	22,673,412.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,906.18	8,906.18
应付托管费	-	-	-	1,781.27	1,781.27
应付清算款	-	-	-	19.74	19.74
其他负债	-	-	-	1,825.28	1,825.28
负债总计	-	-	-	12,532.47	12,532.47
利率敏感度缺口	550,143.03	-	-	22,110,736.99	22,660,880.02

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

6. 4. 13. 4. 1. 2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	11,863,555.59	97.80	22,121,424.46	97.62
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	11,863,555.59	97.80	22,121,424.46	97.62

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%	590,241.25	1,082,348.72
	业绩比较基准下降 5%	-590,241.25	-1,082,348.72

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	11,863,555.59	22,121,424.46
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	11,863,555.59	22,121,424.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,863,555.59	97.73
	其中：股票	11,863,555.59	97.73
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	267,231.43	2.20
8	其他各项资产	7,791.33	0.06
9	合计	12,138,578.35	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	907,424.00	7.48
C	制造业	5,260,110.36	43.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,404,221.90	11.58
E	建筑业	185,153.00	1.53
F	批发和零售业	350,696.21	2.89

G	交通运输、仓储和邮政业	752,832.00	6.21
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,332.10	1.38
J	金融业	2,474,185.02	20.40
K	房地产业	96,036.00	0.79
L	租赁和商务服务业	164,384.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	101,181.00	0.83
S	综合	—	—
	合计	11,863,555.59	97.80

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600141	兴发集团	4,800	225,456.00	1.86
2	600157	永泰能源	123,900	199,479.00	1.64
3	600909	华安证券	17,100	189,981.00	1.57
4	000783	长江证券	18,900	184,275.00	1.52
5	600352	浙江龙盛	14,800	179,228.00	1.48
6	601555	东吴证券	22,600	178,992.00	1.48
7	002966	苏州银行	25,400	176,784.00	1.46
8	601233	桐昆股份	8,100	175,365.00	1.45
9	601108	财通证券	18,500	160,025.00	1.32
10	601958	金钼股份	5,500	154,605.00	1.27
11	601198	东兴证券	11,000	149,490.00	1.23

12	601991	大唐发电	21,100	149,388.00	1.23
13	000703	恒逸石化	10,900	147,913.00	1.22
14	603156	养元饮品	2,900	142,303.00	1.17
15	601665	齐鲁银行	24,500	141,365.00	1.17
16	002056	横店东磁	4,600	140,208.00	1.16
17	600707	彩虹股份	8,200	138,498.00	1.14
18	002432	九安医疗	1,900	134,292.00	1.11
19	002429	兆驰股份	12,900	134,031.00	1.10
20	000060	中金岭南	17,700	133,989.00	1.10
21	002271	东方雨虹	10,900	129,383.00	1.07
22	600109	国金证券	14,700	129,066.00	1.06
23	600060	海信视像	4,400	122,628.00	1.01
24	601128	常熟银行	20,711	120,538.02	0.99
25	600021	上海电力	7,970	120,107.90	0.99
26	601577	长沙银行	13,700	119,327.00	0.98
27	600699	均胜电子	5,500	118,855.00	0.98
28	002078	太阳纸业	9,500	118,655.00	0.98
29	000423	东阿阿胶	2,600	117,936.00	0.97
30	300724	捷佳伟创	1,600	112,960.00	0.93
31	000728	国元证券	14,900	111,601.00	0.92
32	000786	北新建材	5,800	104,922.00	0.86
33	002831	裕同科技	2,923	103,941.88	0.86
34	002673	西部证券	15,200	98,648.00	0.81
35	600177	雅戈尔	13,100	98,643.00	0.81
36	601699	潞安环能	6,800	97,104.00	0.80
37	600642	申能股份	11,100	96,903.00	0.80
38	603345	安井食品	1,200	96,228.00	0.79
39	000623	吉林敖东	5,400	95,742.00	0.79
40	600637	东方明珠	11,510	95,648.10	0.79
41	603225	新凤鸣	4,800	94,320.00	0.78
42	000750	国海证券	25,400	93,472.00	0.77
43	000983	山西焦煤	16,100	93,380.00	0.77
44	002318	久立特材	3,900	93,210.00	0.77
45	600369	西南证券	22,700	91,254.00	0.75
46	603699	纽威股份	1,800	90,540.00	0.75
47	600499	科达制造	6,500	89,700.00	0.74
48	600595	中孚实业	15,900	89,358.00	0.74
49	601016	节能风电	22,200	86,136.00	0.71
50	000415	渤海租赁	21,100	85,877.00	0.71
51	600985	淮北矿业	6,100	85,705.00	0.71
52	601216	君正集团	19,200	85,632.00	0.71
53	000683	博源化工	14,800	85,248.00	0.70
54	601997	贵阳银行	16,600	85,158.00	0.70

55	000039	中集集团	10,500	85,155.00	0.70
56	601717	中创智领	6,100	84,851.00	0.70
57	600863	华能蒙电	17,800	83,660.00	0.69
58	603766	隆鑫通用	7,000	83,510.00	0.69
59	601001	晋控煤业	4,800	83,472.00	0.69
60	600704	物产中大	17,600	83,072.00	0.68
61	600873	梅花生物	11,200	82,320.00	0.68
62	600332	白云山	4,000	80,160.00	0.66
63	600153	建发股份	9,900	78,507.00	0.65
64	600348	华阳股份	10,200	78,030.00	0.64
65	000830	鲁西化工	6,500	78,000.00	0.64
66	002939	长城证券	9,200	76,728.00	0.63
67	600901	江苏金租	13,140	75,555.00	0.62
68	002926	华西证券	9,000	73,530.00	0.61
68	600578	京能电力	11,400	73,530.00	0.61
69	603444	吉比特	200	71,684.00	0.59
70	000591	太阳能	15,500	71,300.00	0.59
71	600398	海澜之家	13,600	71,128.00	0.59
72	000921	海信家电	2,600	71,032.00	0.59
73	002603	以岭药业	4,700	70,500.00	0.58
74	601000	唐山港	16,800	69,720.00	0.57
75	000528	柳 工	9,200	69,460.00	0.57
76	600008	首创环保	25,000	68,000.00	0.56
77	000932	华菱钢铁	19,500	67,665.00	0.56
78	600170	上海建工	30,300	67,266.00	0.55
79	000987	越秀资本	8,600	67,252.00	0.55
80	600998	九州通	14,309	67,109.21	0.55
81	600820	隧道股份	12,500	65,125.00	0.54
82	000951	中国重汽	3,300	64,383.00	0.53
83	600282	南钢股份	14,000	64,260.00	0.53
84	600483	福能股份	6,300	64,197.00	0.53
85	603885	吉祥航空	6,200	63,798.00	0.53
86	600583	海油工程	12,600	63,378.00	0.52
87	002500	山西证券	12,200	62,952.00	0.52
88	603816	顾家家居	2,800	62,608.00	0.52
89	600546	山煤国际	5,600	61,208.00	0.50
90	000582	北部湾港	5,700	61,161.00	0.50
91	603939	益丰药房	3,400	61,132.00	0.50
92	601666	平煤股份	8,400	60,060.00	0.50
93	600329	达仁堂	1,600	59,552.00	0.49
94	603565	中谷物流	6,000	58,860.00	0.49
95	600380	健康元	6,200	58,404.00	0.48
96	601156	东航物流	3,600	58,032.00	0.48

97	000513	丽珠集团	2,000	57,780.00	0.48
98	601880	辽港股份	41,800	57,684.00	0.48
99	600535	天士力	4,200	55,566.00	0.46
100	600511	国药股份	2,100	54,684.00	0.45
101	000598	兴蓉环境	8,500	54,570.00	0.45
102	002244	滨江集团	7,100	53,960.00	0.44
103	002299	圣农发展	3,500	53,060.00	0.44
104	600970	中材国际	7,400	52,762.00	0.43
105	000883	湖北能源	12,100	52,272.00	0.43
106	002120	韵达股份	8,200	52,152.00	0.43
107	000027	深圳能源	8,100	50,220.00	0.41
108	601866	中远海发	22,100	48,841.00	0.40
109	600801	华新建材	3,100	48,360.00	0.40
110	000088	盐田港	11,800	48,262.00	0.40
111	600566	济川药业	2,100	46,599.00	0.38
112	600655	豫园股份	11,100	45,621.00	0.38
113	000709	河钢股份	23,500	45,590.00	0.38
114	600517	国网英大	9,700	45,396.00	0.37
115	601598	中国外运	8,800	43,648.00	0.36
116	001286	陕西能源	4,300	43,602.00	0.36
117	600004	白云机场	5,900	42,834.00	0.35
118	601966	玲珑轮胎	4,200	42,798.00	0.35
119	002423	中粮资本	5,200	42,796.00	0.35
120	600350	山东高速	3,800	42,294.00	0.35
121	600663	陆家嘴	6,700	42,076.00	0.35
122	600582	天地科技	9,400	41,830.00	0.34
123	000429	粤高速 A	3,000	40,950.00	0.34
124	601098	中南传媒	4,100	40,344.00	0.33
125	002508	老板电器	2,700	39,474.00	0.33
126	603233	大参林	2,600	39,078.00	0.32
127	600062	华润双鹤	2,400	38,496.00	0.32
128	600968	海油发展	11,500	38,295.00	0.32
129	601928	凤凰传媒	4,300	37,797.00	0.31
130	601808	中海油服	3,400	36,754.00	0.30
131	600295	鄂尔多斯	3,400	36,448.00	0.30
132	688425	铁建重工	9,044	36,356.88	0.30
133	002032	苏泊尔	900	35,640.00	0.29
134	600098	广州发展	6,000	35,460.00	0.29
135	000539	粤电力 A	5,100	34,731.00	0.29
136	000537	绿发电力	4,700	34,357.00	0.28
137	600377	宁沪高速	2,800	32,396.00	0.27
138	601298	青岛港	4,000	32,200.00	0.27
139	000959	首钢股份	8,800	30,888.00	0.25

140	603833	欧派家居	1,000	30,110.00	0.25
141	002608	江苏国信	4,300	29,670.00	0.24
142	603529	爱玛科技	1,500	29,265.00	0.24
143	600339	中油工程	9,500	29,165.00	0.24
144	600032	浙江新能	4,100	28,905.00	0.24
145	601139	深圳燃气	4,900	27,734.00	0.23
146	000937	冀中能源	6,600	26,268.00	0.22
147	601019	山东出版	3,600	23,040.00	0.19
148	603049	中策橡胶	500	22,405.00	0.18
149	688819	天能股份	778	17,271.60	0.14

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

注：本基金本报告期期末未持有积极投资股票。

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	002202	金风科技	489,943.00	2.16
2	002532	天山铝业	410,295.00	1.81
3	000933	神火股份	407,451.00	1.80
4	002353	杰瑞股份	405,190.38	1.79
5	002966	苏州银行	329,733.00	1.46
6	000960	锡业股份	284,604.00	1.26
7	002128	电投能源	246,961.00	1.09
8	000783	长江证券	245,212.00	1.08
9	002271	东方雨虹	236,954.00	1.05
10	300724	捷佳伟创	223,906.00	0.99
11	002078	太阳纸业	222,915.00	0.98
12	000703	恒逸石化	218,822.00	0.97
13	002432	九安医疗	214,093.00	0.94
14	002080	中材科技	202,565.13	0.89
15	000728	国元证券	195,266.00	0.86
16	000830	鲁西化工	194,839.00	0.86
17	000623	吉林敖东	189,794.00	0.84
18	000683	博源化工	184,980.00	0.82
19	300919	中伟新材	184,497.00	0.81
20	000060	中金岭南	183,247.00	0.81

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	002353	杰瑞股份	1,202,108.00	5.30

2	002202	金风科技	1,057,977.00	4.67
3	000933	神火股份	827,881.00	3.65
4	002532	天山铝业	791,653.00	3.49
5	000960	锡业股份	651,089.00	2.87
6	002080	中材科技	581,944.00	2.57
7	002128	电投能源	539,926.00	2.38
8	002966	苏州银行	453,289.00	2.00
9	300919	中伟新材	399,848.00	1.76
10	600549	厦门钨业	390,252.00	1.72
11	300724	捷佳伟创	372,355.00	1.64
12	002271	东方雨虹	368,035.00	1.62
13	300677	英科医疗	330,638.00	1.46
14	000783	长江证券	325,555.00	1.44
15	002078	太阳纸业	320,954.00	1.42
16	000703	恒逸石化	302,612.00	1.34
17	002429	兆驰股份	287,304.00	1.27
18	002432	九安医疗	271,546.00	1.20
19	000683	博源化工	269,112.00	1.19
20	000060	中金岭南	266,587.00	1.18

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	12,458,324.63
卖出股票收入（成交）总额	16,985,149.02

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	6,891.33
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	900.00
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,791.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 (%)
448	22,363.66	4,330,415.00	43.22	5,688,504.00	56.78

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 4 月 7 日）基金份额总额	585,018,919.00
本报告期期初基金份额总额	19,018,919.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	10,018,919.00

§ 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 (%)	
国信证券	2	14,281,687.51	48.51	2,083.75	48.50	—
中信证券	3	8,229,372.14	27.95	1,201.37	27.96	—
国泰海通	3	6,932,414.00	23.54	1,011.67	23.54	—
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易 单元

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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-

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 500 价值交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部	四大证券报	2026 年 1 月 21 日

	分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》		
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 变更场内简称、扩位简称的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2026 年 2 月 13 日
4	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 13 日
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	《银华中证 500 价值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 13 日
7	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2026 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 13 日
8	《银华中证 500 价值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
11	《银华中证 500 价值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
12	《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
13	《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
14	《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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份	期初	申购	赎回	持有份	份额占

		额比例达到 或者超过 20% 的时间区间	份额	份额	份额	额	比 (%)
机构	1	20260101-20 260224	11,377,4 00.00	3,759,30 0.00	14,137,1 00.00	999,600 .00	9.98
	2	20260225-20 260630	1,344,41 9.00	11,393,5 00.00	9,876,70 0.00	2,861,2 19.00	28.56
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括： 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权； 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会； 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额； 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动； 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华中证 500 价值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 500 价值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 500 价值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 500 价值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