

银华增强收益债券型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.11 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	59
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华增强收益债券型证券投资基金		
基金简称	银华增强收益债券		
基金主代码	180015		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2008 年 12 月 3 日		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	17,081,737,299.09 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D
下属分级基金的交易代码	180015	023823	023513
报告期末下属分级基金的份额总额	3,542,290,332.98 份	3,027,341,542.82 份	10,512,105,423.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险、维护本金相对安全、追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场资金供求状况等因素的基础上，自上而下确定大类金融资产配置和固定收益类金融工具的类属配置，动态调整组合久期，并通过自下而上精选个券，构建和调整固定收益投资组合，获取稳健收益；此外，本基金还将在严格控制风险的前提下积极参加股票一级市场申购，适度参与股票二级市场和权证投资，力争提高投资组合收益率水平。 本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金还可投资于股票、存托凭证、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王小飞
	联系电话	(010) 58163000	021-60637103
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	021-60637228

传真	(010) 58163027	021-60635778
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100738	100033
法定代表人	王珠林	张金良

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	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)		
	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D
本期已实现收益	50,184,969.43	45,752,527.51	146,185,295.15
本期利润	108,745,240.09	94,497,655.84	304,910,802.11
加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0291	0.0311
本期加权平均净值利润率	2.48%	2.19%	2.34%
本期基金份额净值增长率	3.44%	3.29%	3.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D
期末可供分配利润	221,424,170.30	176,664,935.15	653,253,008.17
期末可供分配基金份额利润	0.0625	0.0584	0.0621

期末基金资产净值	4,749,460,881.10	4,046,605,618.60	14,089,946,807.68
期末基金份额净值	1.3408	1.3367	1.3404
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	154.89%	11.58%	11.07%

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

银华增强收益债券 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	2.22%	0.31%	1.17%	0.05%	1.05%	0.26%
过去六个月	3.44%	0.31%	1.98%	0.05%	1.46%	0.26%
过去一年	10.04%	0.30%	1.33%	0.07%	8.71%	0.23%
过去三年	17.79%	0.35%	12.87%	0.09%	4.92%	0.26%
过去五年	20.25%	0.34%	23.86%	0.09%	-3.61%	0.25%
过去七年	39.35%	0.32%	34.01%	0.10%	5.34%	0.22%
过去十年	49.40%	0.29%	47.27%	0.10%	2.13%	0.19%
自基金合同生效起至今	154.89%	0.28%	96.00%	0.11%	58.89%	0.17%

银华增强收益债券 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	2.15%	0.31%	1.17%	0.05%	0.98%	0.26%
过去六个月	3.29%	0.31%	1.98%	0.05%	1.31%	0.26%
过去一年	9.72%	0.30%	1.33%	0.07%	8.39%	0.23%

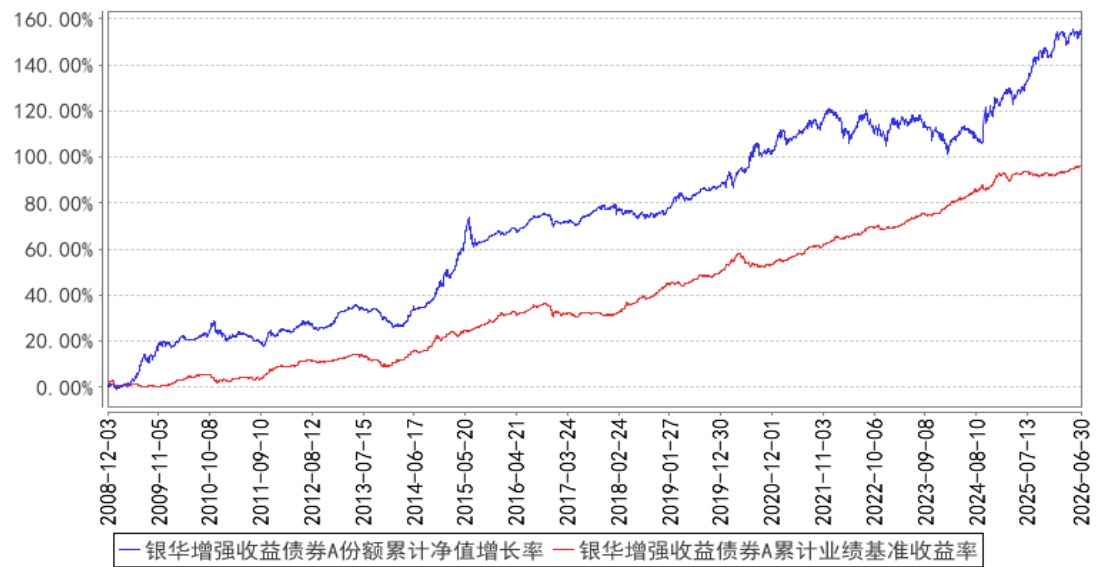
自基金合同 生效起至今	11.58%	0.32%	2.91%	0.08%	8.67%	0.24%
----------------	--------	-------	-------	-------	-------	-------

银华增强收益债券 D

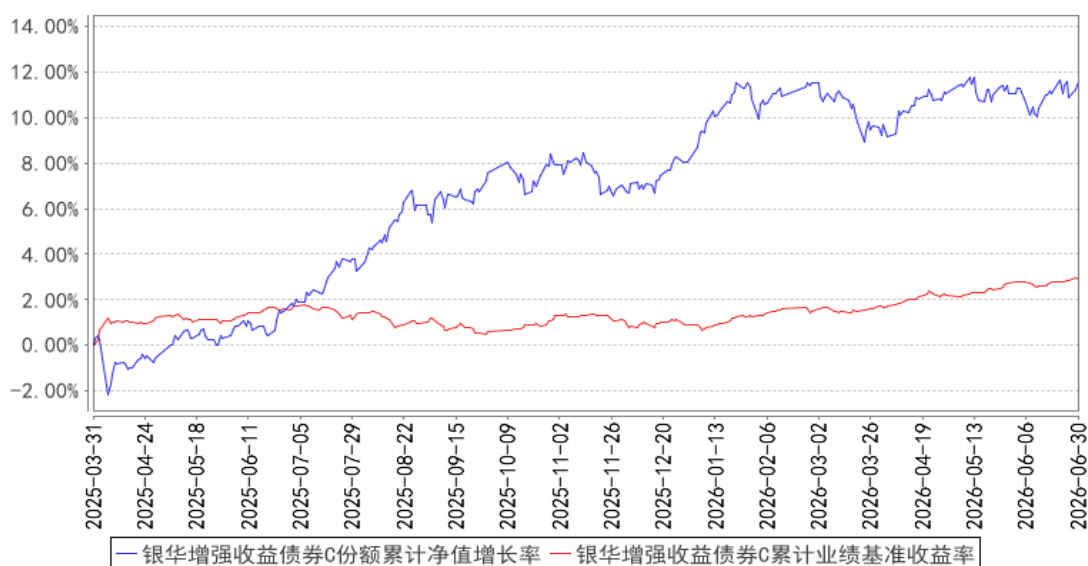
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.22%	0.31%	1.17%	0.05%	1.05%	0.26%
过去六个月	3.45%	0.31%	1.98%	0.05%	1.47%	0.26%
过去一年	10.04%	0.30%	1.33%	0.07%	8.71%	0.23%
自基金合同 生效起至今	11.07%	0.31%	2.56%	0.09%	8.51%	0.22%

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

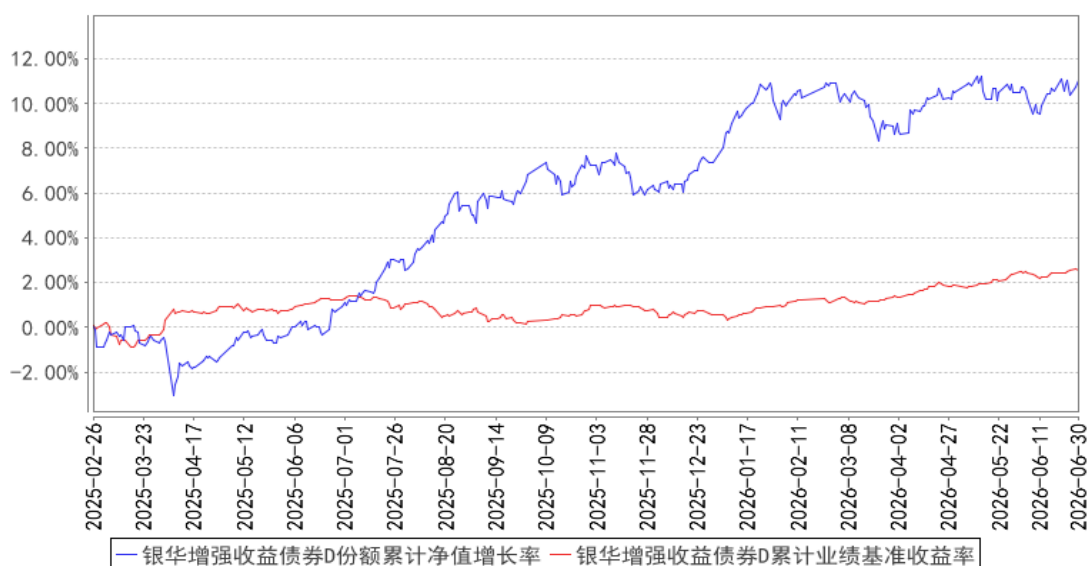
银华增强收益债券A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银华增强收益债券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



银华增强收益债券D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		
冯帆女士	本基金的基金经理	2020 年 12 月 29 日	-	12 年	硕士学位。曾就职于华夏未来资本管理有限公司，2015 年 8 月加入银华基金，历任投资管理三部宏观利率研究员、基金经理助理，现任养老金及多资产投资管理部团队长/基金经理/投资经理（年金、养老金）/投资经理助理（社保、基本养老）。自 2020 年 12 月 29 日起担任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 12 日起兼任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华钰祥债券型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2026 年 3 月 18 日起兼任银华启元债券型证券投资基金基金经理，自 2026 年 5 月 18 日起兼任银华启恒 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2026 年 8 月 18 日起兼任银华启成 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张雨先生	本基金的基金经理助理	2023 年 7 月 14 日	-	5.5 年	博士学位。2020 年 7 月加入银华基金管理股份有限公司，现任养老金及多资产投资管理部基金经理助理/投资经理助理（社保、基本养老）。具有从业资格。国籍：中国。
张兴权先生	本基金的基金经理助理	2026 年 1 月 29 日	-	10 年	大学本科。曾就职于美国道富环球资产管理公司，2020 年 10 月加入银华基金管理股份有限公司，现任养老金及多资产投资管理部基金经理助理、投资经理助理（年金、养老金）。具有从业资格。国籍：中国。

魏晟峻先生	本基金的基金经理助理	2019 年 11 月 15 日	2026 年 5 月 18 日	12.5 年	硕士学位，曾就职于信达创新有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，历任投资管理三部固收交易部助理询价交易员、固定收益投资管理部基金经理助理，现任固定收益投资管理部投资经理。具有从业资格。国籍：中国。
常立先生	本基金的基金经理助理	2025 年 2 月 25 日	2026 年 1 月 30 日	9.5 年	硕士学位。曾就职于嘉实基金管理有限公司、中国国际金融股份有限公司。2022 年 11 月加入银华基金，曾任养老金及多资产投资管理部基金经理助理。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、《银华增强收益债券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

回顾 2026 年上半年，美伊地缘冲突持续演绎并贯穿始终，全球风险资产波动率整体抬升。国内权益、转债、纯债三类资产整体呈现高波动、快轮动、强分化的运行特征。一季度，地缘冲突引发全球资产高波联动，权益市场震荡上行后阶段性调整；转债市场整体先扬后抑；纯债市场收益率呈区间震荡走势。二季度，地缘冲突从高潮逐步走向阶段性缓和，微观交易结构走向极致，K 型分化显著，后半程波动率明显抬升；转债市场维持“高估值、窄区间、快波动”特征；纯债市场前半段在宽松资金面驱动下震荡走强，后半段伴随资金面边际收敛出现阶段性调整，期限结构分化加剧。

报告期内，我们继续坚守资产配置、类属增强、回撤管理三位一体的策略框架，以规则化、量化的决策体系应对外部事件冲击与内部结构波动，围绕胜率与赔率动态优化组合，持续完善流动性风险预警与波动率拆解管理机制。资产配置层面，对含权资产维持中枢略偏积极的定位，结合微观交易结构的极致化特征动态管控风险敞口，阶段性小幅调整仓位并在股票与转债间做结构腾挪；在极致风格环境下坚持均衡化策略导向，不追逐短期赛道锐度，依托量化体系深耕细分领域超额收益。权益资产方面，持续运行量化多因子类属增强策略，面对极致行情下的阶段性超额压力，坚持策略长期定位，不做短期风格偏离；同步推进策略版本迭代优化，拓展因子维度与合成方式，着力提升不同市场环境下的策略适应性与压力场景表现下限。转债资产方面，始终作为权益补充敞口进行管理，围绕估值波动开展逆向操作，以优化持仓结构、提升盈亏比为核心；深化分域择券体系，偏股区注重估值高位止盈，平衡区深度挖掘期权特征价值，偏债区防范正股低动量下的时间价值损耗，在估值回落阶段把握不对称性交易机会。纯债资产方面维持中性久期定位，以底仓 Carry 收益为基础，将久期分布结构优化置于重要位置；顺应资金面变化推动杠杆策略适度转向曲线策略，聚焦中段至中段品种挖掘利差压缩机会，对短端低赔率、长端低胜率的区域保持审慎，结合资金边际变化开展窄区间逆向交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华增强收益债券 A 基金份额净值为 1.3408 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.44%；截至本报告期末银华增强收益债券 C 基金份额净值为 1.3367 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.29%；截至本报告期末银华增强收益债券 D 基金份额净值为 1.3404 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.45%；业绩比较基准收益率为 1.98%。

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，随着中报预告密集披露、美联储议息会议、国内政策窗口与大型科技企业 IPO

等事件陆续落地，极致微观交易结构有望迎来改善，定价线索与 alpha 来源有望趋于多元。在结构调整与波动率抬升交织的环境下，组合运作将继续坚持均衡稳健导向，以规则化框架应对不确定性，在市场波动中积极捕捉错误定价与逆向机会。权益端将持续优化量化策略适配性，等待微观结构风险释放后把握多元 alpha 机会；转债端密切跟踪估值和与权益市场联动性，深化分域增强下的个券挖掘；纯债端重点观察资金面稳态重建进程，在波动率收敛后把握利差的交易机会。整体而言，我们将继续淡化短期叙事与情绪博弈，持续完善风险模型与策略迭代，在管控组合波动的前提下，追求长期风险收益比的优化，力争为持有人实现稳健可持续的复利回报。

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

本基金管理人于 2026 年 01 月 13 日发布分红公告，向于 2026 年 01 月 14 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每 10 份 A 类基金份额分配红利人民币 0.319 元，实际分配收益金额为人民币 74,879,867.76 元，每 10 份 C 类基金份额分配红利人民币 0.319 元，实际分配收益金额为人民币 78,699,492.04 元，每 10 份 D 类基金份额分配红利人民币 0.319 元，实际分配收益金额为人民币 205,725,611.38 元。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：银华增强收益债券型证券投资基金

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	89,885,880.89	305,401,459.70
结算备付金		351,563,767.93	86,055,586.89
存出保证金		2,613,086.32	689,583.86
交易性金融资产	6.4.7.2	28,326,644,359.20	14,546,889,297.14
其中：股票投资		4,374,441,056.09	2,453,866,736.55
基金投资		-	-
债券投资		23,952,203,303.11	12,093,022,560.59
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	768,000,000.00	69,997,957.27
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		84,929,811.59	-
应收股利		-	-
应收申购款		87,973,969.87	195,995,000.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		29,711,610,875.80	15,205,028,885.81
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		6,614,498,087.58	2,399,852,014.28
应付清算款		109,815,125.94	273,314,192.07
应付赎回款		71,403,271.11	32,859,039.41
应付管理人报酬		12,194,583.51	6,083,712.26
应付托管费		3,752,179.54	1,871,911.46
应付销售服务费		1,050,275.59	785,643.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,700,484.98	3,070,023.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	9,183,560.17	3,177,665.70
负债合计		6,825,597,568.42	2,721,014,202.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	17,081,737,299.09	9,409,687,060.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,804,276,008.29	3,074,327,623.04
净资产合计		22,886,013,307.38	12,484,014,683.64
负债和净资产总计		29,711,610,875.80	15,205,028,885.81

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，银华增强收益债券 A 基金份额净值 1.3408 元，基金份额总额 3,542,290,332.98 份；银华增强收益债券 C 基金份额净值 1.3367 元，基金份额总额 3,027,341,542.82 份；银华增强收益债券 D 基金份额净值 1.3404 元，基金份额总额 10,512,105,423.29 份。银华增强收益债券份额总额合计为 17,081,737,299.09 份。

6.2 利润表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

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		641,751,293.80	42,359,827.04
1. 利息收入		3,462,885.10	138,721.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,281,611.51	70,857.25
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		2,181,273.59	67,864.57
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		371,440,727.83	20,732,646.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	16,976,090.06	-118,138.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	318,108,919.74	17,288,231.85
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	36,355,718.03	3,562,553.75
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	266,030,905.95	21,411,964.07
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	816,774.92	76,494.33
减：二、营业总支出		133,597,595.76	6,987,504.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	69,918,449.58	3,399,036.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,513,369.13	1,045,857.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,416,298.34	13,643.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		35,171,651.17	2,390,874.94
其中：卖出回购金融资产支出		35,171,651.17	2,390,874.94

6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		435,267.77	24,894.42
8. 其他费用	6.4.7.23	142,559.77	113,196.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		508,153,698.04	35,372,323.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		508,153,698.04	35,372,323.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		508,153,698.04	35,372,323.04

6.3 净资产变动表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	9,409,687,060.60	-	3,074,327,623.04	12,484,014,683.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	9,409,687,060.60	-	3,074,327,623.04	12,484,014,683.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,672,050,238.49	-	2,729,948,385.25	10,401,998,623.74
（一）、综合收益总额	-	-	508,153,698.04	508,153,698.04
（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）	7,672,050,238.49	-	2,581,099,658.39	10,253,149,896.88
其中：1. 基金申购款	18,465,088,978.96	-	6,117,925,412.04	24,583,014,391.00
2. 基金	-10,793,038,740.4	-	-3,536,825,753.65	-14,329,864,494.1

赎回款	7			2
(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)	-	-	-359,304,971.18	-359,304,971.18
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	17,081,737,299.09	-	5,804,276,008.29	22,886,013,307.38
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	258,679,007.96	-	56,468,451.77	315,147,459.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	258,679,007.96	-	56,468,451.77	315,147,459.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,412,941,602.94	-	357,605,812.52	1,770,547,415.46
(一)、综合收益总额	-	-	35,372,323.04	35,372,323.04
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,412,941,602.94	-	324,949,817.55	1,737,891,420.49
其中：1. 基金申购款	1,689,283,338.65	-	389,196,230.47	2,078,479,569.12
2. 基金赎回款	-276,341,735.71	-	-64,246,412.92	-340,588,148.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-2,716,328.07	-2,716,328.07

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	1,671,620,610.90	-	414,074,264.29	2,085,694,875.19

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

银华增强收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2008]1157 号文《关于核准银华增强收益债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2008 年 10 月 30 日至 2008 年 11 月 28 日向社会公开募集，基金合同于 2008 年 12 月 3 日生效。首次设立募集规模为 2,466,876,891.58 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《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信息披露管理办法》等法律法规的规定和《银华增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关约定，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协商一致，决定自 2025 年 2 月 26 日起对银华增强收益债券型证券投资基金增设 D 类基金份额，自 2025 年 3 月 31 日起对银华增强收益债券型证券投资基金增设 C 类基金份额，据此及相关法律法规的更新对本基金的基金合同、托管协议做相应修改。在增设 D 类基金份额前投资人已经持有的本基金原有基金份额，将全部转为 A 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额以及 D 类基金份额均由银华基金管理股份有限公司担任登记机构。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、存托凭证、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国债、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债

券)、短期融资券、资产支持证券等固定收益类金融工具。本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有现金或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、应收申购款等。本基金还可投资于股票、存托凭证、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	89,885,880.89
等于：本金	89,882,027.67
加：应计利息	3,853.22
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	89,885,880.89

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		4,169,343,640.13	-	4,374,441,056.09	205,097,415.96
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	7,734,088,080.99	51,206,892.41	7,856,095,452.04	70,800,478.64
	银行间 市场	15,899,977,290.32	134,256,051.07	16,096,107,851.07	61,874,509.68
	合计	23,634,065,371.31	185,462,943.48	23,952,203,303.11	132,674,988.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		27,803,409,011.44	185,462,943.48	28,326,644,359.20	337,772,404.28

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	768,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	768,000,000.00	—
----	----------------	---

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	678.45
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	8,985,927.11
其中：交易所市场	8,918,887.11
银行间市场	67,040.00
应付利息	—

预提费用	186,658.65
其他	10,295.96
合计	9,183,560.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华增强收益债券 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	1,803,740,757.73	1,803,740,757.73
本期申购	2,978,218,359.32	2,978,218,359.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,239,668,784.07	-1,239,668,784.07
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	3,542,290,332.98	3,542,290,332.98

银华增强收益债券 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	2,280,612,632.11	2,280,612,632.11
本期申购	5,142,730,512.49	5,142,730,512.49
本期赎回（以“-”号填列）	-4,396,001,601.78	-4,396,001,601.78
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	3,027,341,542.82	3,027,341,542.82

银华增强收益债券 D

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	5,325,333,670.76	5,325,333,670.76
本期申购	10,344,140,107.15	10,344,140,107.15
本期赎回（以“-”号填列）	-5,157,368,354.62	-5,157,368,354.62
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	10,512,105,423.29	10,512,105,423.29

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

银华增强收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,473,876.15	454,194,646.20	590,668,522.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	136,473,876.15	454,194,646.20	590,668,522.35
本期利润	50,184,969.43	58,560,270.66	108,745,240.09
本期基金份额交易产生的变动数	109,645,192.48	472,991,460.96	582,636,653.44
其中：基金申购款	188,360,045.58	804,688,418.96	993,048,464.54
基金赎回款	-78,714,853.10	-331,696,958.00	-410,411,811.10
本期已分配利润	-74,879,867.76	-	-74,879,867.76
本期末	221,424,170.30	985,746,377.82	1,207,170,548.12

银华增强收益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	167,610,332.06	574,449,480.31	742,059,812.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	167,610,332.06	574,449,480.31	742,059,812.37
本期利润	45,752,527.51	48,745,128.33	94,497,655.84
本期基金份额交易产生的变动数	42,001,567.62	219,404,531.99	261,406,099.61
其中：基金申购款	314,991,778.59	1,380,249,844.98	1,695,241,623.57
基金赎回款	-272,990,210.97	-1,160,845,312.99	-1,433,835,523.96
本期已分配利润	-78,699,492.04	-	-78,699,492.04
本期末	176,664,935.15	842,599,140.63	1,019,264,075.78

银华增强收益债券 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	400,989,900.14	1,340,609,388.18	1,741,599,288.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	400,989,900.14	1,340,609,388.18	1,741,599,288.32
本期利润	146,185,295.15	158,725,506.96	304,910,802.11
本期基金份额交易产生的变动数	311,803,424.26	1,425,253,481.08	1,737,056,905.34

其中：基金申购款	637,579,808.01	2,792,055,515.92	3,429,635,323.93
基金赎回款	-325,776,383.75	-1,366,802,034.84	-1,692,578,418.59
本期已分配利润	-205,725,611.38	-	-205,725,611.38
本期末	653,253,008.17	2,924,588,376.22	3,577,841,384.39

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	389,401.56
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	419,733.24
其他	472,476.71
合计	1,281,611.51

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	16,976,090.06
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	16,976,090.06

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	14,366,613,357.43
减：卖出股票成本总额	14,326,945,874.75
减：交易费用	22,691,392.62
买卖股票差价收入	16,976,090.06

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	208,043,472.04

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	110,065,447.70
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	318,108,919.74

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,126,640,639.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,969,579,379.19
减：应计利息总额	46,469,653.77
减：交易费用	526,158.70
买卖债券差价收入	110,065,447.70

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	36,355,718.03
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	36,355,718.03

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	266,030,905.95
股票投资	175,863,298.09
债券投资	90,167,607.86
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	266,030,905.95

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	813,403.50

基金转换费收入	3,371.42
合计	816,774.92

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	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	22,120.21
账户维护费	18,600.00
其他	180.91
合计	142,559.77

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
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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（%）
第一创业	590,545,228.08	1.94	-	-
东北证券	825,425,208.45	2.71	-	-
西南证券	1,521,806,833.72	5.00	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

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 成交总额 的比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
第一创业	95,402,517.51	0.68	-	-
东北证券	182,544,637.88	1.31	-	-
西南证券	796,052,360.46	5.70	-	-

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（%）
第一创业	16,441,455,000.00	4.92	-	-
东北证券	817,400,000.00	0.24	-	-
西南证券	8,365,889,000.00	2.50	-	-

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（%）
东北证券	368,062.19	2.71	71,318.49	0.80
第一创业	263,319.75	1.94	263,319.75	2.95
西南证券	678,583.44	5.00	562,634.30	6.31
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（%）
-	-	-	-	-

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	69,918,449.58	3,399,036.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,088,096.28	355,916.81
应支付基金管理人的净管理费	60,830,353.30	3,043,119.81

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.65%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.65\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	21,513,369.13	1,045,857.36

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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方名称	本期 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			
	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D	合计
银华基金	-	2,317,865.60	-	2,317,865.60
合计	-	2,317,865.60	-	2,317,865.60
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			
	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D	合计
银华基金	-	9,919.28	-	9,919.28
合计	-	9,919.28	-	9,919.28

注：（1）基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额和 D 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 类基金份额资产净值的 0.30%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H=E\times 0.30\%/ \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2025 年 3 月 31 日起增设 C 类基金份额

（3）本基金自 2025 年 2 月 26 日起增设 D 类基金份额

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
中国建设银行	89,885,880.89	389,401.56	14,320,688.34	42,978.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

单位：人民币元

银华增强收益债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 14 日	-	2026 年 1 月 14 日	0.319	63,882,351.33	10,997,516.43	74,879,867.76	-

合计	-	-	-	0.319	63,882,351.33	10,997,516.43	74,879,867.76	-
银华增强收益债券 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 14 日	-	2026 年 1 月 14 日	0.319	66,202,494.62	12,496,997.42	78,699,492.04	-
合计	-	-	-	0.319	66,202,494.62	12,496,997.42	78,699,492.04	-
银华增强收益债券 D								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 14 日	-	2026 年 1 月 14 日	0.319	165,344,749.40	40,380,861.98	205,725,611.38	-
合计	-	-	-	0.319	165,344,749.40	40,380,861.98	205,725,611.38	-

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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026 年 6 月 10 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	2,070	207,000.00	207,009.53	-
113705	豪26转债	2026 年 6 月 15 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	4,180	418,000.00	418,029.32	-

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 2,200,411,087.58 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102381546	23 汇金 MTN004	2026 年 7 月 1 日	102.60	2,100,000	215,457,491.51
102580354	25 电网 MTN002	2026 年 7 月 1 日	101.35	2,780,000	281,765,719.45
102582430	25 华能 MTN011	2026 年 7 月 1 日	100.29	1,053,000	105,601,036.83
102582926	25 京国资 MTN008	2026 年 7 月 1 日	101.88	1,550,000	157,910,950.96
102583259	25 苏交通 MTN008	2026 年 7 月 1 日	102.17	1,335,000	136,391,068.69
102583303	25 沪电力 MTN005	2026 年 7 月 1 日	101.68	1,500,000	152,521,865.75
102583374	25 京国资 MTN010	2026 年 7 月 1 日	101.79	375,000	38,171,788.36
102583997	25 中航集 MTN001	2026 年 7 月 1 日	102.33	1,516,000	155,134,464.70
102584305	25 沪国际集 MTN001(科创债)	2026 年 7 月 1 日	101.88	2,000,000	203,759,835.62
102584696	25 东航 MTN005	2026 年 7 月 1 日	101.50	1,666,000	169,100,816.63
102680240	26 苏交通 MTN001(并购)	2026 年 7 月 1 日	101.17	1,112,000	112,506,511.65
102580354	25 电网 MTN002	2026 年 7 月 2 日	101.35	2,632,000	266,765,242.30
102584159	25 中交建 MTN001	2026 年 7 月 6 日	102.31	635,000	64,964,097.75
102585357	25 光大集团 MTN008	2026 年 7 月 6 日	101.62	3,050,000	309,930,153.70
合计				23,304,000	2,369,981,043.90

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,414,087,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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	89,885,880.89	-	-	-	89,885,880.89
结算备付金	351,563,767.93	-	-	-	351,563,767.93
存出保证金	2,613,086.32	-	-	-	2,613,086.32
交易性金融资产	3,340,791,466.87	16,945,905,035.28	3,665,506,800.96	4,374,441,056.09	28,326,644,359.20
买入返售金融资产	768,000,000.00	-	-	-	768,000,000.00
应收申购款	-	-	-	87,973,969.87	87,973,969.87
应收清算款	-	-	-	84,929,811.59	84,929,811.59
资产总计	4,552,854,202.	16,945,905,035	3,665,506,800.	4,547,344,837.	29,711,610,875.80

	01	. 28	96	55	
负债					
应付赎回款	-	-	-	71,403,271.11	71,403,271.11
应付管理人报酬	-	-	-	12,194,583.51	12,194,583.51
应付托管费	-	-	-	3,752,179.54	3,752,179.54
应付清算款	-	-	-	109,815,125.94	109,815,125.94
卖出回购金融资产款	6,614,498,087.58	-	-	-	6,614,498,087.58
应付销售服务费	-	-	-	1,050,275.59	1,050,275.59
应交税费	-	-	-	3,700,484.98	3,700,484.98
其他负债	-	-	-	9,183,560.17	9,183,560.17
负债总计	6,614,498,087.58	-	-	211,099,480.84	6,825,597,568.42
利率敏感度缺口	-2,061,643,885.57	16,945,905,035.28	3,665,506,800.96	4,336,245,356.71	22,886,013,307.38
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	305,401,459.70	-	-	-	305,401,459.70
结算备付金	86,055,586.89	-	-	-	86,055,586.89
存出保证金	689,583.86	-	-	-	689,583.86
交易性金融资产	2,817,848,338.66	6,157,224,428.71	3,117,949,793.22	2,453,866,736.55	14,546,889,297.14
买入返售金融资产	69,997,957.27	-	-	-	69,997,957.27
应收申购款	-	-	-	195,995,000.95	195,995,000.95
资产总计	3,279,992,926.38	6,157,224,428.71	3,117,949,793.22	2,649,861,737.50	15,205,028,885.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,859,039.41	32,859,039.41
应付管理人报酬	-	-	-	6,083,712.26	6,083,712.26
应付托管费	-	-	-	1,871,911.46	1,871,911.46
应付清算款	-	-	-	273,314,192.07	273,314,192.07
卖出回购金融资产款	2,399,852,014.28	-	-	-	2,399,852,014.28
应付销售服务费	-	-	-	785,643.89	785,643.89
应交税费	-	-	-	3,070,023.10	3,070,023.10
其他负债	-	-	-	3,177,665.70	3,177,665.70
负债总计	2,399,852,014.28	-	-	321,162,187.89	2,721,014,202.17
利率敏感度缺口	880,140,912.10	6,157,224,428.71	3,117,949,793.22	2,328,699,549.61	12,484,014,683.64

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低利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）
	+25 个基点	-156,645,569.79	-74,362,668.81
	-25 个基点	156,645,569.79	74,362,668.81

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	4,374,441,056.09	19.11	2,453,866,736.55	19.66
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	23,952,203,303.11	104.66	12,093,022,560.59	96.87

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	28,326,644,359.20	123.77	14,546,889,297.14	116.52

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%	-128,498,829.19	-446,934,660.62
	业绩比较基准下降 5%	128,498,829.19	446,934,660.62

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	5,852,494,300.03	4,211,664,499.21
第二层次	22,474,150,059.17	10,335,224,797.93
第三层次	—	—
合计	28,326,644,359.20	14,546,889,297.14

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	4,374,441,056.09	14.72
	其中：股票	4,374,441,056.09	14.72
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	23,952,203,303.11	80.62
	其中：债券	23,952,203,303.11	80.62
	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	768,000,000.00	2.58
	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	441,449,648.82	1.49
8	其他各项资产	175,516,867.78	0.59
9	合计	29,711,610,875.80	100.00

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	-	-
B	采矿业	168,155,282.40	0.73
C	制造业	3,054,304,012.03	13.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,788,708.00	0.43
E	建筑业	35,167,556.00	0.15
F	批发和零售业	32,106,916.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	82,585,474.00	0.36
H	住宿和餐饮业	331,016.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	209,353,489.64	0.91
J	金融业	603,825,003.72	2.64
K	房地产业	4,318,155.00	0.02
L	租赁和商务服务业	3,908,635.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	45,456,209.18	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	20,714,749.20	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,696,249.92	0.07
R	文化、体育和娱乐业	729,600.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,374,441,056.09	19.11

7.2.2 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

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	300604	长川科技	273,600	93,412,512.00	0.41
2	300628	亿联网络	2,585,533	87,442,726.06	0.38
3	603986	兆易创新	106,420	86,732,300.00	0.38
4	600030	中信证券	2,896,630	83,220,179.90	0.36
5	600482	中国动力	2,043,756	67,035,196.80	0.29
6	688012	中微公司	130,300	61,045,550.00	0.27
7	601108	财通证券	7,029,300	60,803,445.00	0.27
8	000725	京东方 A	5,504,600	47,779,928.00	0.21
9	300373	扬杰科技	280,700	44,134,461.00	0.19

10	002558	巨人网络	1,563,400	43,087,304.00	0.19
11	300346	南大光电	448,100	41,516,465.00	0.18
12	300408	三环集团	246,960	41,217,624.00	0.18
13	002463	沪电股份	263,060	40,195,568.00	0.18
14	300857	协创数据	116,860	39,720,714.00	0.17
15	601166	兴业银行	2,371,600	39,273,696.00	0.17
16	603259	药明康德	311,100	38,735,061.00	0.17
17	603993	洛阳钼业	2,147,600	37,690,380.00	0.16
18	600549	厦门钨业	441,300	37,598,760.00	0.16
19	600183	生益科技	216,000	37,454,400.00	0.16
20	688469	芯联集成	3,427,492	36,365,690.12	0.16
21	300054	鼎龙股份	337,300	35,743,681.00	0.16
22	601318	中国平安	736,033	35,138,215.42	0.15
23	300285	国瓷材料	334,587	34,522,686.66	0.15
24	601231	环旭电子	1,036,900	33,595,560.00	0.15
25	603179	新泉股份	664,500	32,992,425.00	0.14
26	600487	亨通光电	300,000	32,802,000.00	0.14
27	601688	华泰证券	1,555,200	32,068,224.00	0.14
28	688192	迪哲医药	770,336	30,759,516.48	0.13
29	603688	石英股份	369,900	30,557,439.00	0.13
30	000776	广发证券	1,290,220	30,191,148.00	0.13
31	300458	全志科技	763,580	30,130,866.80	0.13
32	600339	中油工程	9,544,300	29,301,001.00	0.13
33	000878	云南铜业	1,817,300	28,858,724.00	0.13
34	300223	君正股份	115,000	28,623,500.00	0.13
35	601818	光大银行	9,860,900	28,498,001.00	0.12
36	600764	中国海防	1,633,646	28,474,449.78	0.12
37	601211	国泰海通	1,557,700	28,350,140.00	0.12
38	603019	中科曙光	263,425	28,247,062.75	0.12
39	688002	睿创微纳	180,934	27,988,680.46	0.12
40	601169	北京银行	5,691,900	27,890,310.00	0.12
41	601229	上海银行	3,206,900	27,835,892.00	0.12
42	601233	桐昆股份	1,261,700	27,315,805.00	0.12
43	603225	新凤鸣	1,336,303	26,258,353.95	0.11
44	600160	巨化股份	483,700	25,640,937.00	0.11
45	002532	天山铝业	2,382,032	25,559,203.36	0.11
46	000933	神火股份	1,204,400	25,533,280.00	0.11
47	601138	工业富联	348,155	25,119,383.25	0.11
48	002414	高德红外	1,865,900	24,741,834.00	0.11
49	600887	伊利股份	1,022,749	24,505,066.04	0.11
50	000050	深天马 A	2,455,000	24,329,050.00	0.11
51	600642	申能股份	2,767,800	24,162,894.00	0.11
52	603659	璞泰来	798,300	23,094,819.00	0.10

53	688019	安集科技	68,010	23,086,674.60	0.10
54	600031	三一重工	1,331,554	23,009,253.12	0.10
55	688295	中复神鹰	371,889	22,514,160.06	0.10
56	000408	藏格矿业	317,500	22,009,100.00	0.10
57	002410	广联达	2,660,500	21,709,680.00	0.09
58	000951	中国重汽	1,110,300	21,661,953.00	0.09
59	688336	三生国健	402,245	21,359,209.50	0.09
60	688396	华润微	215,912	21,062,215.60	0.09
61	603379	三美股份	276,500	20,983,585.00	0.09
62	000733	振华科技	366,200	20,741,568.00	0.09
63	002025	航天电器	270,600	20,625,132.00	0.09
64	688472	阿特斯	1,898,597	20,542,819.54	0.09
65	000651	格力电器	546,841	20,506,537.50	0.09
66	601615	明阳智能	1,771,700	20,498,569.00	0.09
67	000034	神州数码	724,080	20,093,220.00	0.09
68	000960	锡业股份	468,300	19,991,727.00	0.09
69	688017	绿的谐波	47,602	19,890,971.72	0.09
70	300390	天华新能	212,600	19,880,226.00	0.09
71	600499	科达制造	1,438,800	19,855,440.00	0.09
72	000657	中钨高新	207,400	19,852,328.00	0.09
73	688213	思特威	183,124	19,607,086.68	0.09
74	688676	金盘科技	231,525	19,596,276.00	0.09
75	300454	深信服	202,500	19,480,500.00	0.09
76	300395	菲利华	145,622	19,474,030.06	0.09
77	002185	华天科技	863,300	19,260,223.00	0.08
78	688187	时代电气	277,877	19,079,034.82	0.08
79	601898	中煤能源	1,559,700	18,997,146.00	0.08
80	600309	万华化学	277,600	18,990,616.00	0.08
81	603345	安井食品	234,999	18,844,569.81	0.08
82	603296	华勤技术	253,160	18,802,193.20	0.08
83	600741	华域汽车	1,207,300	18,737,296.00	0.08
84	600909	华安证券	1,665,600	18,504,816.00	0.08
85	600498	烽火通信	251,300	18,495,680.00	0.08
86	000739	普洛药业	1,106,200	18,429,292.00	0.08
87	600150	中国船舶	541,108	18,284,039.32	0.08
88	600390	五矿资本	3,994,700	18,215,832.00	0.08
89	601399	国机重装	5,196,400	18,187,400.00	0.08
90	000921	海信家电	663,500	18,126,820.00	0.08
91	600536	中国软件	644,150	18,113,498.00	0.08
92	601916	浙商银行	6,857,300	18,034,699.00	0.08
93	002120	韵达股份	2,827,900	17,985,444.00	0.08
94	601360	三六零	2,068,100	17,971,789.00	0.08
95	601018	宁波港	5,698,000	17,948,700.00	0.08

96	002152	广电运通	1,910,500	17,920,490.00	0.08
97	688728	格科微	849,074	17,864,516.96	0.08
98	600995	南网储能	1,448,200	17,812,860.00	0.08
99	601058	赛轮轮胎	1,524,350	17,575,755.50	0.08
100	000738	航发控制	956,200	17,488,898.00	0.08
101	688009	中国通号	3,658,721	17,415,511.96	0.08
102	002299	圣农发展	1,141,200	17,300,592.00	0.08
103	300502	新易盛	28,440	17,263,080.00	0.08
104	002429	兆驰股份	1,653,400	17,178,826.00	0.08
105	603766	隆鑫通用	1,426,800	17,021,724.00	0.07
106	688303	大全能源	974,686	16,988,776.98	0.07
107	002266	浙富控股	3,349,000	16,945,940.00	0.07
108	688520	神州细胞	489,093	16,731,871.53	0.07
109	600497	驰宏锌锗	1,375,200	16,653,672.00	0.07
110	002958	青农商行	6,072,800	16,639,472.00	0.07
111	301536	星辰科技	128,900	16,590,719.00	0.07
112	600970	中材国际	2,326,300	16,586,519.00	0.07
113	301358	湖南裕能	217,800	16,524,486.00	0.07
114	000426	兴业银锡	499,000	16,447,040.00	0.07
115	601336	新华保险	273,200	16,299,112.00	0.07
116	601328	交通银行	2,532,800	16,285,904.00	0.07
117	600029	南方航空	3,091,800	16,015,524.00	0.07
118	600808	马钢股份	6,280,900	15,702,250.00	0.07
119	300136	信维通信	131,500	15,681,375.00	0.07
120	601168	西部矿业	577,100	15,662,494.00	0.07
121	002064	华峰化学	1,577,100	14,966,679.00	0.07
122	600601	方正科技	1,077,600	14,913,984.00	0.07
123	600763	通策医疗	428,584	14,520,425.92	0.06
124	601825	沪农商行	1,924,200	14,412,258.00	0.06
125	300124	汇川技术	213,500	14,161,455.00	0.06
126	002851	麦格米特	84,600	14,143,428.00	0.06
127	600737	中粮糖业	1,140,800	14,066,064.00	0.06
128	688387	信科移动	698,619	13,860,600.96	0.06
129	600999	招商证券	655,200	13,824,720.00	0.06
130	600132	重庆啤酒	334,700	13,823,110.00	0.06
131	000831	中国稀土	248,600	13,794,814.00	0.06
132	002049	紫光国微	154,500	13,711,875.00	0.06
133	600176	中国巨石	187,500	13,665,000.00	0.06
134	300433	蓝思科技	249,800	13,404,268.00	0.06
135	000591	太阳能	2,901,700	13,347,820.00	0.06
136	601665	齐鲁银行	2,308,100	13,317,737.00	0.06
137	601398	工商银行	1,882,900	13,312,103.00	0.06
138	601766	中国中车	2,555,800	13,290,160.00	0.06

139	688617	惠泰医疗	72,049	13,081,216.44	0.06
140	688041	海光信息	34,697	12,848,299.10	0.06
141	688183	生益电子	96,981	12,840,284.40	0.06
142	600011	华能国际	1,675,500	12,717,045.00	0.06
143	601872	招商轮船	715,900	12,578,363.00	0.05
144	605358	立昂微	161,300	12,516,880.00	0.05
145	601006	大秦铁路	2,658,100	12,253,841.00	0.05
146	600015	华夏银行	1,884,400	12,041,316.00	0.05
147	688702	盛科通信	30,846	12,029,631.54	0.05
148	600109	国金证券	1,341,200	11,775,736.00	0.05
149	000703	恒逸石化	843,100	11,440,867.00	0.05
150	002541	鸿路钢构	658,300	11,401,756.00	0.05
151	688301	奕瑞科技	90,254	11,191,496.00	0.05
152	000807	云铝股份	490,800	10,866,312.00	0.05
153	002415	海康威视	316,973	10,840,476.60	0.05
154	600372	中航机载	969,800	10,522,330.00	0.05
155	300308	中际旭创	8,200	10,414,000.00	0.05
156	300760	迈瑞医疗	76,600	10,404,578.00	0.05
157	601088	中国神华	263,200	10,275,328.00	0.04
158	300394	天孚通信	33,280	10,073,190.40	0.04
159	601390	中国中铁	2,183,400	9,104,778.00	0.04
160	688615	合合信息	79,669	9,010,563.90	0.04
161	000988	华工科技	47,500	8,768,975.00	0.04
162	002241	歌尔股份	387,900	8,739,387.00	0.04
163	000568	泸州老窖	105,550	8,182,236.00	0.04
164	688578	艾力斯	74,642	8,150,906.40	0.04
165	002281	光迅科技	30,600	7,862,364.00	0.03
166	688008	澜起科技	24,794	7,683,660.60	0.03
167	601899	紫金矿业	286,800	7,210,152.00	0.03
168	601857	中国石油	823,200	7,145,376.00	0.03
169	600690	海尔智家	346,300	7,067,983.00	0.03
170	002929	润建股份	105,500	7,055,840.00	0.03
171	300476	胜宏科技	20,300	7,032,529.00	0.03
172	600027	华电国际	1,573,800	7,003,410.00	0.03
173	600023	浙能电力	1,322,800	6,957,928.00	0.03
174	000783	长江证券	713,600	6,957,600.00	0.03
175	600219	南山铝业	1,729,600	6,901,104.00	0.03
176	601377	兴业证券	1,132,400	6,839,696.00	0.03
177	603031	安孚科技	128,300	6,831,975.00	0.03
178	603979	金诚信	114,800	6,776,644.00	0.03
179	002913	奥士康	105,300	6,732,882.00	0.03
180	000538	云南白药	138,864	6,577,987.68	0.03
181	301308	江波龙	9,300	6,545,340.00	0.03

182	688220	翱捷科技	51,560	6,409,939.20	0.03
183	002409	雅克科技	27,900	6,263,550.00	0.03
184	002947	恒铭达	81,200	6,175,260.00	0.03
185	688981	中芯国际	38,349	6,090,588.18	0.03
186	603163	圣晖集成	40,200	5,889,300.00	0.03
187	600276	恒瑞医药	112,800	5,870,112.00	0.03
188	002938	鹏鼎控股	53,000	5,585,140.00	0.02
189	603067	振华股份	118,900	5,503,881.00	0.02
190	688347	华虹宏力	16,327	5,490,770.10	0.02
191	300570	太辰光	21,600	5,328,936.00	0.02
192	688385	复旦微电	73,980	5,274,034.20	0.02
193	300567	精测电子	16,500	5,240,400.00	0.02
194	300620	光库科技	13,700	5,181,340.00	0.02
195	600028	中国石化	1,136,090	5,066,961.40	0.02
196	603444	吉比特	14,100	5,053,722.00	0.02
197	002850	科达利	26,500	5,016,450.00	0.02
198	688686	奥普特	28,475	4,794,905.25	0.02
199	600522	中天科技	77,800	4,720,904.00	0.02
200	688111	金山办公	22,140	4,716,927.00	0.02
201	600585	海螺水泥	274,800	4,657,860.00	0.02
202	688036	传音控股	78,548	4,630,404.60	0.02
203	600998	九州通	962,400	4,513,656.00	0.02
204	300888	稳健医疗	159,200	4,456,008.00	0.02
205	301606	绿联科技	72,900	4,448,358.00	0.02
206	600378	昊华科技	57,200	4,311,736.00	0.02
207	600352	浙江龙盛	350,012	4,238,645.32	0.02
208	600166	福田汽车	1,455,600	4,235,796.00	0.02
209	002028	思源电气	24,300	4,203,900.00	0.02
210	300012	华测检测	295,600	4,097,016.00	0.02
211	300450	先导智能	99,100	4,035,352.00	0.02
212	600988	赤峰黄金	153,200	4,032,224.00	0.02
213	003010	若羽臣	165,600	4,024,080.00	0.02
214	002624	完美世界	322,300	4,002,966.00	0.02
215	002821	凯莱英	24,500	3,969,000.00	0.02
216	601991	大唐发电	558,000	3,950,640.00	0.02
217	000893	亚钾国际	96,000	3,925,440.00	0.02
218	600570	恒生电子	179,700	3,807,843.00	0.02
219	688778	厦钨新能	69,392	3,774,924.80	0.02
220	002156	通富微电	49,700	3,770,739.00	0.02
221	000528	柳 工	498,800	3,765,940.00	0.02
222	002916	深南电路	8,200	3,754,780.00	0.02
223	300438	鹏辉能源	45,200	3,744,820.00	0.02
224	603129	春风动力	14,600	3,734,680.00	0.02

225	300003	乐普医疗	311,100	3,686,535.00	0.02
226	688772	珠海冠宇	176,566	3,465,990.58	0.02
227	000600	建投能源	392,900	3,437,875.00	0.02
228	603786	科博达	83,300	3,407,803.00	0.01
229	600873	梅花生物	461,600	3,392,760.00	0.01
230	301110	青木科技	89,600	3,392,256.00	0.01
231	600141	兴发集团	72,000	3,381,840.00	0.01
232	002271	东方雨虹	284,600	3,378,202.00	0.01
233	300972	万辰集团	19,200	3,329,472.00	0.01
234	001389	广合科技	14,015	3,325,058.75	0.01
235	601800	中国交建	570,900	3,259,839.00	0.01
236	002312	川发龙蟒	349,500	3,204,915.00	0.01
237	002436	兴森科技	62,600	3,189,470.00	0.01
238	688605	先锋精科	30,383	3,160,439.66	0.01
239	300207	欣旺达	164,900	3,131,451.00	0.01
240	600266	城建发展	796,500	3,114,315.00	0.01
241	688599	天合光能	219,538	3,099,876.56	0.01
242	002304	洋河股份	80,900	3,086,335.00	0.01
243	300748	金力永磁	99,900	3,081,915.00	0.01
244	601156	东航物流	189,100	3,048,292.00	0.01
245	688543	国科军工	77,032	3,038,912.40	0.01
246	600901	江苏金租	527,700	3,034,275.00	0.01
247	688322	奥比中光	23,103	3,016,096.65	0.01
248	600298	安琪酵母	82,800	2,997,360.00	0.01
249	600546	山煤国际	273,200	2,986,076.00	0.01
250	002475	立讯精密	42,300	2,977,920.00	0.01
251	603678	火炬电子	35,200	2,921,600.00	0.01
252	603338	浙江鼎力	68,600	2,915,500.00	0.01
253	688150	莱特光电	41,942	2,878,060.04	0.01
254	300001	特锐德	76,000	2,875,080.00	0.01
255	002130	沃尔核材	149,000	2,825,040.00	0.01
256	000415	渤海租赁	678,500	2,761,495.00	0.01
257	002756	永兴材料	46,800	2,650,752.00	0.01
258	601139	深圳燃气	459,000	2,597,940.00	0.01
259	000792	盐湖股份	86,000	2,596,340.00	0.01
260	600131	国网信通	177,600	2,592,960.00	0.01
261	600118	中国卫星	31,400	2,576,370.00	0.01
262	002603	以岭药业	166,800	2,502,000.00	0.01
263	002353	杰瑞股份	16,400	2,501,000.00	0.01
264	000708	中信特钢	194,860	2,459,133.20	0.01
265	300724	捷佳伟创	34,800	2,456,880.00	0.01
266	601000	唐山港	591,900	2,456,385.00	0.01
267	300496	中科创达	39,700	2,453,063.00	0.01

268	002080	中材科技	27,200	2,448,000.00	0.01
269	300432	富临精工	121,300	2,436,917.00	0.01
270	300627	华测导航	85,200	2,419,680.00	0.01
271	300772	运达股份	196,600	2,418,180.00	0.01
272	603233	大参林	160,000	2,404,800.00	0.01
273	601717	中创智领	169,200	2,353,572.00	0.01
274	603087	甘李药业	41,000	2,327,160.00	0.01
275	301217	铜冠铜箔	14,000	2,310,980.00	0.01
276	301000	肇民科技	70,800	2,266,308.00	0.01
277	002258	利尔化学	177,600	2,257,296.00	0.01
278	600098	广州发展	381,800	2,256,438.00	0.01
279	600967	内蒙一机	206,700	2,242,695.00	0.01
280	002444	巨星科技	71,200	2,214,320.00	0.01
281	002345	潮宏基	240,200	2,202,634.00	0.01
282	300631	久吾高科	94,300	2,173,615.00	0.01
283	002517	恺英网络	132,400	2,151,500.00	0.01
284	688480	赛恩斯	24,380	2,135,444.20	0.01
285	000063	中兴通讯	58,800	2,127,972.00	0.01
286	000729	燕京啤酒	205,600	2,082,728.00	0.01
287	600332	白云山	103,600	2,076,144.00	0.01
288	301196	唯科科技	16,380	2,054,379.60	0.01
289	601128	常熟银行	351,670	2,046,719.40	0.01
290	000997	新大陆	124,800	2,034,240.00	0.01
291	600583	海油工程	404,400	2,034,132.00	0.01
292	301080	百普赛斯	41,800	2,006,400.00	0.01
293	301153	中科江南	117,140	1,908,210.60	0.01
294	600066	宇通客车	70,800	1,898,148.00	0.01
295	300731	科创新源	31,780	1,854,680.80	0.01
296	688819	天能股份	81,523	1,809,810.60	0.01
297	000623	吉林敖东	99,800	1,769,454.00	0.01
298	600801	华新建材	112,200	1,750,320.00	0.01
299	600418	江淮汽车	66,900	1,728,027.00	0.01
300	002939	长城证券	200,900	1,675,506.00	0.01
301	300815	玉禾田	99,900	1,633,365.00	0.01
302	000932	华菱钢铁	466,400	1,618,408.00	0.01
303	000596	古井贡酒	19,500	1,556,100.00	0.01
304	600578	京能电力	235,100	1,516,395.00	0.01
305	601918	新集能源	174,000	1,494,660.00	0.01
306	600061	国投资本	227,300	1,488,815.00	0.01
307	000157	中联重科	212,800	1,483,216.00	0.01
308	300684	中石科技	24,200	1,476,200.00	0.01
309	000786	北新建材	80,400	1,454,436.00	0.01
310	600686	金龙汽车	116,800	1,318,672.00	0.01

311	002293	罗莱生活	130,900	1,294,601.00	0.01
312	601997	贵阳银行	252,300	1,294,299.00	0.01
313	000555	神州信息	119,700	1,232,910.00	0.01
314	002244	滨江集团	158,400	1,203,840.00	0.01
315	600985	淮北矿业	82,600	1,160,530.00	0.01
316	000581	威孚高科	66,800	1,136,936.00	0.00
317	002948	青岛银行	213,500	1,084,580.00	0.00
318	600060	海信视像	37,000	1,031,190.00	0.00
319	002466	天齐锂业	16,800	1,030,176.00	0.00
320	300017	网宿科技	74,700	971,847.00	0.00
321	002261	拓维信息	34,300	960,743.00	0.00
322	002432	九安医疗	13,400	947,112.00	0.00
323	600483	福能股份	92,900	946,651.00	0.00
324	000830	鲁西化工	77,600	931,200.00	0.00
325	603816	顾家家居	40,820	912,735.20	0.00
326	002215	诺普信	110,500	909,415.00	0.00
327	601577	长沙银行	102,300	891,033.00	0.00
328	603699	纽威股份	17,700	890,310.00	0.00
329	688070	纵横股份	23,560	879,494.80	0.00
330	600177	雅戈尔	116,000	873,480.00	0.00
331	300573	兴齐眼药	21,235	865,538.60	0.00
332	600938	中国海油	31,700	860,655.00	0.00
333	600885	宏发股份	24,400	841,556.00	0.00
334	688039	当虹科技	22,531	840,856.92	0.00
335	603882	金域医学	37,300	838,504.00	0.00
336	600392	盛和资源	27,600	821,652.00	0.00
337	603486	科沃斯	15,900	806,925.00	0.00
338	688428	诺诚健华	28,232	803,765.04	0.00
339	600562	国睿科技	37,600	797,872.00	0.00
340	000629	钒钛股份	220,900	737,806.00	0.00
341	601019	山东出版	114,000	729,600.00	0.00
342	603267	鸿远电子	9,200	712,816.00	0.00
343	000400	许继电气	32,100	696,570.00	0.00
344	002518	科士达	12,500	669,875.00	0.00
345	000338	潍柴动力	23,200	632,200.00	0.00
346	603939	益丰药房	34,800	625,704.00	0.00
347	002508	老板电器	42,700	624,274.00	0.00
348	600704	物产中大	131,200	619,264.00	0.00
349	688222	成都先导	19,238	617,732.18	0.00
350	300662	科锐国际	36,300	616,374.00	0.00
351	601567	三星电气	41,000	612,540.00	0.00
352	603456	九洲药业	44,300	605,138.00	0.00
353	688321	微芯生物	22,975	604,931.75	0.00

354	300073	当升科技	12,400	595,696.00	0.00
355	601958	金钼股份	20,500	576,255.00	0.00
356	002039	黔源电力	29,900	562,718.00	0.00
357	002966	苏州银行	79,500	553,320.00	0.00
358	002926	华西证券	65,500	535,135.00	0.00
359	601555	东吴证券	67,200	532,224.00	0.00
360	600511	国药股份	20,000	520,800.00	0.00
361	000598	兴蓉环境	80,700	518,094.00	0.00
362	300002	神州泰岳	64,800	506,088.00	0.00
363	600389	江山股份	25,900	505,568.00	0.00
364	600415	小商品城	49,200	499,872.00	0.00
365	600481	双良节能	98,700	492,513.00	0.00
366	600282	南钢股份	106,900	490,671.00	0.00
367	002736	国信证券	48,500	484,515.00	0.00
368	688556	高测股份	35,571	472,382.88	0.00
369	600879	航天电子	22,000	468,380.00	0.00
370	600312	平高电气	26,100	460,926.00	0.00
371	601628	中国人寿	12,600	445,410.00	0.00
372	300491	通合科技	11,600	443,004.00	0.00
373	000423	东阿阿胶	9,700	439,992.00	0.00
374	601001	晋控煤业	25,200	438,228.00	0.00
375	002202	金风科技	18,300	437,370.00	0.00
376	000887	中鼎股份	24,100	431,149.00	0.00
377	300442	润泽科技	4,800	398,736.00	0.00
378	300244	迪安诊断	18,000	337,320.00	0.00
379	600754	锦江酒店	18,400	331,016.00	0.00
380	600699	均胜电子	15,200	328,472.00	0.00
381	600502	安徽建工	75,200	327,120.00	0.00
382	601333	广深铁路	108,700	298,925.00	0.00
383	000938	紫光股份	9,600	277,056.00	0.00
384	000039	中集集团	32,860	266,494.60	0.00
385	300735	光弘科技	10,800	245,592.00	0.00
386	300792	壹网壹创	9,200	238,648.00	0.00
387	002284	亚太股份	22,600	214,474.00	0.00
388	600126	杭钢股份	31,600	193,708.00	0.00
389	603899	晨光股份	7,300	150,599.00	0.00
390	002841	视源股份	1,800	62,154.00	0.00
391	600210	紫江企业	5,200	32,240.00	0.00
392	301349	信德新材	428	31,500.80	0.00
393	600057	厦门象屿	5,700	30,894.00	0.00
394	300033	同花顺	120	28,920.00	0.00
395	000021	深科技	300	19,281.00	0.00
396	000422	湖北宜化	800	11,240.00	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	300750	宁德时代	332,189,373.58	2.66
2	600036	招商银行	290,279,599.00	2.33
3	601877	正泰电器	225,512,280.11	1.81
4	601318	中国平安	217,662,855.97	1.74
5	600887	伊利股份	214,864,097.67	1.72
6	600030	中信证券	212,795,156.86	1.70
7	300628	亿联网络	173,346,610.17	1.39
8	601166	兴业银行	162,192,012.58	1.30
9	601899	紫金矿业	155,922,436.93	1.25
10	000338	潍柴动力	147,628,820.00	1.18
11	000651	格力电器	138,176,341.00	1.11
12	600406	国电南瑞	127,162,862.93	1.02
13	603259	药明康德	106,007,621.22	0.85
14	603986	兆易创新	104,281,367.53	0.84
15	600690	海尔智家	102,857,156.70	0.82
16	601138	工业富联	88,033,175.30	0.71
17	603379	三美股份	87,437,793.00	0.70
18	600795	国电电力	87,159,192.00	0.70
19	300408	三环集团	86,629,716.26	0.69
20	000568	泸州老窖	85,233,788.56	0.68

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	300750	宁德时代	351,377,167.77	2.81
2	600036	招商银行	292,652,614.18	2.34
3	600887	伊利股份	282,811,480.46	2.27
4	601877	正泰电器	238,623,444.05	1.91
5	601166	兴业银行	212,735,555.28	1.70
6	601318	中国平安	204,351,022.00	1.64
7	000338	潍柴动力	160,294,857.10	1.28
8	600030	中信证券	154,255,236.38	1.24
9	600406	国电南瑞	153,884,879.42	1.23
10	000651	格力电器	152,980,315.50	1.23
11	601899	紫金矿业	131,792,079.33	1.06
12	002008	大族激光	112,219,514.00	0.90
13	600795	国电电力	105,625,672.00	0.85
14	600919	江苏银行	101,337,200.78	0.81

15	000999	华润三九	97,709,961.30	0.78
16	601138	工业富联	90,312,599.27	0.72
17	600170	上海建工	89,920,146.12	0.72
18	000783	长江证券	89,913,727.78	0.72
19	600196	复星医药	86,211,228.29	0.69
20	600998	九州通	86,155,052.80	0.69

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	16,071,656,896.20
卖出股票收入（成交）总额	14,366,613,357.43

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	823,768,741.19	3.60
2	央行票据	—	—
3	金融债券	11,070,999,579.77	48.37
	其中：政策性金融债	2,595,252,279.66	11.34
4	企业债券	1,004,718,587.76	4.39
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	9,338,832,536.76	40.81
7	可转债（可交换债）	1,478,678,282.79	6.46
8	同业存单	—	—
9	其他	235,205,574.84	1.03
10	合计	23,952,203,303.11	104.66

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102580354	25 电网 MTN002	7,250,000	734,820,671.23	3.21
2	250431	25 农发 31	5,000,000	506,345,479.45	2.21
3	244573	26GTH01	5,000,000	506,214,109.60	2.21
4	250220	25 国开 20	4,850,000	495,776,035.62	2.17
5	244658	26 招证 G2	4,000,000	404,824,219.16	1.77

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	2,613,086.32
2	应收清算款	84,929,811.59
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	87,973,969.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	175,516,867.78

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	110,973,541.42	0.48
2	113056	重银转债	82,918,652.73	0.36
3	123104	卫宁转债	74,963,113.81	0.33
4	123176	精测转2	71,022,753.47	0.31
5	113062	常银转债	56,238,586.87	0.25

6	118034	晶能转债	55,845,515.47	0.24
7	123258	胜蓝转 02	52,526,079.28	0.23
8	118031	天 23 转债	49,153,494.65	0.21
9	123122	富瀚转债	45,729,984.13	0.20
10	123109	昌红转债	43,981,718.83	0.19
11	113677	华懋转债	40,871,791.48	0.18
12	113647	禾丰转债	39,889,941.19	0.17
13	110090	爱迪转债	36,977,481.45	0.16
14	118020	芳源转债	36,772,867.28	0.16
15	113691	和邦转债	36,452,507.39	0.16
16	118022	锂科转债	35,889,447.55	0.16
17	113678	中贝转债	34,022,349.58	0.15
18	123255	鼎龙转债	32,204,987.99	0.14
19	123216	科顺转债	32,125,920.80	0.14
20	118051	皓元转债	28,504,945.20	0.12
21	118024	冠宇转债	25,831,685.74	0.11
22	128136	立讯转债	23,001,665.20	0.10
23	127046	百润转债	22,857,042.57	0.10
24	123247	万凯转债	22,837,713.92	0.10
25	123251	华医转债	22,386,982.19	0.10
26	113658	密卫转债	22,125,240.08	0.10
27	123124	晶瑞转 2	18,528,914.99	0.08
28	113051	节能转债	15,803,297.91	0.07
29	123259	锦浪转 02	15,227,626.40	0.07
30	127064	杭氧转债	13,983,235.10	0.06
31	118059	颀中转债	12,274,731.08	0.05
32	113650	博 22 转债	11,267,030.40	0.05
33	123257	安克转债	10,776,815.13	0.05
34	127056	中特转债	10,764,875.32	0.05
35	111020	合顺转债	10,486,767.98	0.05
36	127103	东南转债	9,916,098.21	0.04
37	111000	起帆转债	9,848,367.41	0.04
38	123144	裕兴转债	9,557,812.22	0.04
39	113667	春 23 转债	9,267,113.67	0.04
40	113661	福 22 转债	9,154,177.49	0.04
41	111015	东亚转债	8,391,714.72	0.04
42	118015	芯海转债	6,921,156.60	0.03
43	127088	赫达转债	6,585,057.10	0.03
44	123225	翔丰转债	6,491,866.69	0.03
45	118052	浩瀚转债	4,847,174.02	0.02
46	118035	国力转债	4,596,973.60	0.02
47	110095	双良转债	4,593,320.17	0.02
48	123165	回天转债	4,591,729.06	0.02

49	123149	通裕转债	4,587,560.55	0.02
50	123171	共同转债	4,582,810.31	0.02
51	113680	丽岛转债	4,522,604.31	0.02
52	123183	海顺转债	4,474,359.44	0.02
53	113697	应流转债	4,337,271.86	0.02
54	123189	晓鸣转债	4,122,250.42	0.02
55	123261	普联转债	2,516,781.21	0.01
56	118036	力合转债	2,295,104.02	0.01

7.11.5 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。

7.11.6 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 (%)
银华增强 收益债券 A	21,186	167,199.58	3,390,157,458.57	95.71	152,132,874.41	4.29
银华增强 收益债券 C	18,407	164,466.86	2,785,928,846.32	92.03	241,412,696.50	7.97
银华增强 收益债券 D	627	16,765,718.38	10,505,017,882.71	99.93	7,087,540.58	0.07
合计	40,220	424,707.54	16,681,104,187.60	97.65	400,633,111.49	2.35

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 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	银华增强收益债券 A	2,010,110.98	0.06

有从业人员持 有本基金	银华增强收益债券 C	32.00	0.00
	银华增强收益债券 D	113,441.39	0.00
	合计	2,123,584.37	0.01

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

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	银华增强收益债券 A	10~50
	银华增强收益债券 C	-
	银华增强收益债券 D	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	银华增强收益债券 A	10~50
	银华增强收益债券 C	-
	银华增强收益债券 D	-
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华增强收益债券 A	银华增强收益债券 C	银华增强收益债券 D
基金合同生效日(2008 年 12 月 3 日)基金份 额总额	2,466,876,891.58	-	-
本报告期期初基金份 额总额	1,803,740,757.73	2,280,612,632.11	5,325,333,670.76
本报告期基金总申购 份额	2,978,218,359.32	5,142,730,512.49	10,344,140,107.15
减：本报告期基金总赎 回份额	1,239,668,784.07	4,396,001,601.78	5,157,368,354.62
本报告期基金拆分变 动份额	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	3,542,290,332.98	3,027,341,542.82	10,512,105,423.29

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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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：无

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无

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	3	4,456,699,924.36	14.66	1,987,278.79	14.66	-
广发证券	2	3,810,236,731.71	12.53	1,699,007.11	12.53	-
华创证券	2	3,405,573,599	11.20	1,518,567.26	11.20	-

		. 75				
国金证券	2	3, 114, 154, 799 . 08	10. 24	1, 388, 603. 90	10. 24	-
兴业证券	3	2, 755, 322, 692 . 88	9. 06	1, 228, 604. 29	9. 06	-
西部证券	2	2, 721, 552, 968 . 53	8. 95	1, 213, 520. 60	8. 95	-
招商证券	2	1, 730, 088, 337 . 04	5. 69	771, 473. 10	5. 69	-
华福证券	3	1, 548, 970, 507 . 10	5. 09	690, 714. 57	5. 09	-
西南证券	3	1, 521, 806, 833 . 72	5. 00	678, 583. 44	5. 00	-
中金公司	2	1, 299, 268, 802 . 07	4. 27	579, 388. 55	4. 27	-
长江证券	2	1, 166, 039, 107 . 81	3. 83	519, 936. 84	3. 83	-
国泰海通	4	1, 130, 715, 515 . 82	3. 72	504, 187. 06	3. 72	-
东北证券	5	825, 425, 208. 4 5	2. 71	368, 062. 19	2. 71	-
第一创业	2	590, 545, 228. 0 8	1. 94	263, 319. 75	1. 94	-
申万宏源	1	330, 079, 019. 4 8	1. 09	147, 211. 52	1. 09	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	0	-	-	-	-	撤销

						2 个交易单元
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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	1,014,642,465.62	7.26	42,401,466,000.00	12.68	-	-
广发证券	1,374,659,	9.84	21,553,053,0	6.45	-	-

	749.57		00.00			
华创证券	2,317,637,003.65	16.59	39,199,903,000.00	11.73	-	-
国金证券	848,893,755.19	6.07	56,623,172,000.00	16.94	-	-
兴业证券	1,357,809,704.48	9.72	9,607,312,000.00	2.87	-	-
西部证券	516,225,725.33	3.69	39,422,138,000.00	11.79	-	-
招商证券	1,593,868,054.23	11.41	7,924,866,000.00	2.37	-	-
华福证券	673,606,094.63	4.82	37,173,773,000.00	11.12	-	-
西南证券	796,052,360.46	5.70	8,365,889,000.00	2.50	-	-
中金公司	1,103,783,827.30	7.90	29,026,354,000.00	8.68	-	-
长江证券	1,193,754,108.25	8.54	5,391,839,000.00	1.61	-	-
国泰海通	486,562,685.02	3.48	4,495,152,000.00	1.34	-	-
东北证券	182,544,637.88	1.31	817,400,000.00	0.24	-	-
第一创业	95,402,517.51	0.68	16,441,455,000.00	4.92	-	-
申万宏源	418,823,466.88	3.00	15,877,764,000.00	4.75	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	《银华增强收益债券型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2026 年 1 月 8 日
2	《银华增强收益债券型证券投资基金恢复大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2026 年 1 月 13 日
3	《银华增强收益债券型证券投资基金分红公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2026 年 1 月 13 日
4	《银华增强收益债券型证券投资基金 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
5	《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
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的赤峰黄金估值方法	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2026 年 3 月 21 日

	调整的公告》	网站, 四大证券报	
7	《银华增强收益债券型证券投资基金 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
8	《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
9	《银华增强收益债券型证券投资基金 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
10	《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	《银华增强收益债券型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 5 月 8 日
12	《银华增强收益债券型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 5 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

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 中国证监会核准银华增强收益债券型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华增强收益债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华增强收益债券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
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

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