

银华华证 ESG 领先指数证券投资基金 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	6
§ 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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

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	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
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	48
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华华证 ESG 领先指数证券投资基金
基金简称	银华华证 ESG 领先指数
基金主代码	013174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 19 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,976,630.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采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。 基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
业绩比较基准	华证 ESG 领先指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张立学
	联系电话	(010) 58163000	010-68858126
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95580
传真		(010) 58163027	010-86353609
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 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		100738	100808

法定代表人	王珠林	郑国雨
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年1月1日 - 2026年6月30日)
本期已实现收益	848,192.38
本期利润	1,578,923.58
加权平均基金份额本期利润	0.1380
本期加权平均净值利润率	12.02%
本期基金份额净值增长率	12.20%
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	2,698,284.72
期末可供分配基金份额利润	0.2458
期末基金资产净值	13,674,915.51
期末基金份额净值	1.2458
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	24.58%

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

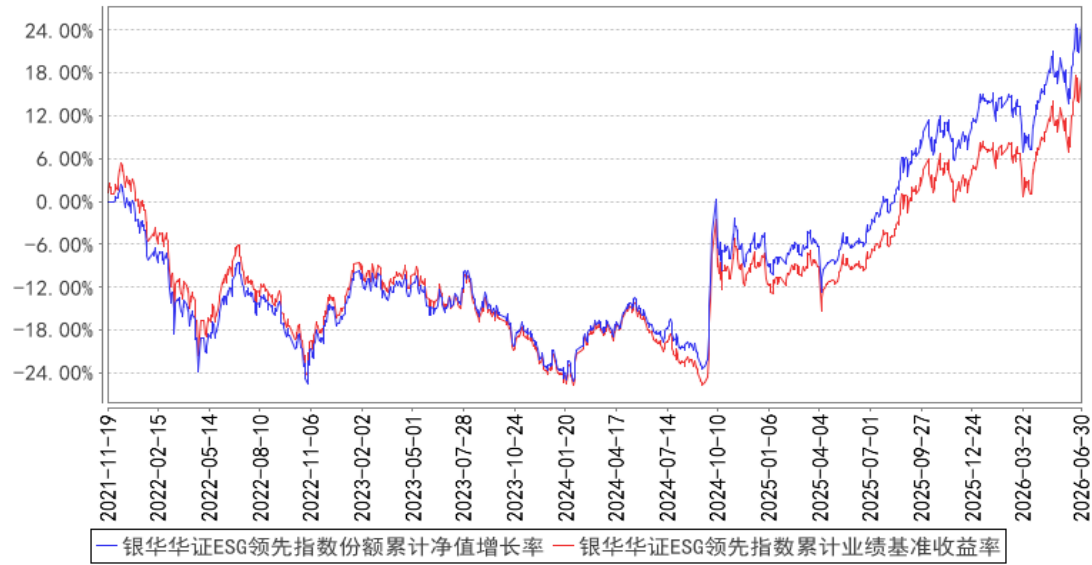
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	15.62%	1.27%	15.47%	1.29%	0.15%	-0.02%

过去六个月	12.20%	1.14%	12.25%	1.16%	-0.05%	-0.02%
过去一年	29.65%	0.99%	27.28%	1.00%	2.37%	-0.01%
过去三年	45.81%	1.02%	37.09%	1.03%	8.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	24.58%	1.03%	17.25%	1.05%	7.33%	-0.02%

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

银华华证ESG领先指数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		
谭普景先生	本基金的基金经理	2026 年 6 月 15 日	-	12 年	大学本科。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金。现任量化投资部基金经理。自 2025 年 12 月 5 日起担任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,自 2026 年 2 月 10 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,自 2026 年 4 月 1 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,自 2026 年 5 月 6 日起兼任银华中证机器人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 6 月 15 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联接基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、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、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张亦驰先生	本基金的基金经理	2021 年 11 月 23 日	-	11 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 5 月 25 日至 2023 年 9 月 27 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 5 月 25 日至 2024 年 8 月 28 日兼任银华巨潮小盘价值交易

					型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日至 2024 年 4 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 11 月 23 日至 2026 年 7 月 15 日兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日至 2023 年 9 月 27 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日起兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日至 2024 年 7 月 16 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日至 2023 年 12 月 19 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日至 2024 年 7 月 16 日兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日起兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 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 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 4 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联接基金基金经理，自 2023 年 12 月 20 日至 2025 年 12 月 10 日兼任银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 3 月 6 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 4 月 25 日起兼任银华中证 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 5 月 6 日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 23 日起兼任银华中证港股
--	--	--	--	--	--

					通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 12 月 3 日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2025 年 9 月 17 日起兼任银华中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 11 日起兼任银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2026 年 6 月 18 日起兼任银华上证科创板芯片设计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。
- 3、张亦驰先生自 2026 年 7 月 15 日起不再担任本基金基金经理。

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、《银华华证 ESG 领先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，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2458 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.20%，业绩比较基准收益率为 12.25%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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 2025 年 10 月 31 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。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华华证 ESG 领先指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：银华华证 ESG 领先指数证券投资基金

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	853,612.97	1,097,624.74
结算备付金		35.23	169.54
存出保证金		3,778.68	23,295.61
交易性金融资产	6.4.7.2	12,886,906.72	12,038,463.92
其中：股票投资		12,886,906.72	12,038,463.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		1,592.15	244.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		13,745,925.75	13,159,798.56
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		0.01	768.80
应付赎回款		36,124.58	179,724.27
应付管理人报酬		5,599.58	5,518.33
应付托管费		1,119.90	1,103.66
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	28,166.17	61,652.85
负债合计		71,010.24	248,767.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	10,976,630.79	11,628,685.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,698,284.72	1,282,345.19
净资产合计		13,674,915.51	12,911,030.65
负债和净资产总计		13,745,925.75	13,159,798.56

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2458 元，基金份额总额 10,976,630.79 份。

6.2 利润表

会计主体：银华华证 ESG 领先指数证券投资基金

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		1,645,160.46	1,119,519.25
1. 利息收入		3,430.02	11,668.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,430.02	11,668.71
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）		910,449.49	2,411,954.07
其中：股票投资收益	6.4.7.14	797,670.09	1,617,136.37
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	112,779.40	794,817.70
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	730,731.20	-1,320,612.54
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	549.75	16,509.01
减：二、营业总支出		66,236.88	196,001.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,468.23	122,010.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,493.58	24,402.14
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	27,275.07	49,588.57
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,578,923.58	923,517.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,578,923.58	923,517.65
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,578,923.58	923,517.65

6.3 净资产变动表

会计主体：银华华证 ESG 领先指数证券投资基金

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	11,628,685.46	-	1,282,345.19	12,911,030.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,628,685.46	-	1,282,345.19	12,911,030.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-652,054.67	-	1,415,939.53	763,884.86
（一）、综合收益总额	-	-	1,578,923.58	1,578,923.58
（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）	-652,054.67	-	-162,984.05	-815,038.72
其中：1. 基金申购款	4,557,729.11	-	654,144.56	5,211,873.67
2. 基金赎回款	-5,209,783.78	-	-817,128.61	-6,026,912.39
（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	10,976,630.79	-	2,698,284.72	13,674,915.51
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	54,288,167.77	-	-3,073,381.55	51,214,786.22
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,288,167.77	-	-3,073,381.55	51,214,786.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,563,180.61	-	1,011,304.37	-551,876.24
（一）、综合收益总额	-	-	923,517.65	923,517.65
（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）	-1,563,180.61	-	87,786.72	-1,475,393.89
其中：1. 基金申购款	5,611,623.59	-	-361,107.56	5,250,516.03
2. 基金赎回款	-7,174,804.20	-	448,894.28	-6,725,909.92
（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	52,724,987.16	-	-2,062,077.18	50,662,909.98

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

银华华证 ESG 领先指数证券投资基金(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[2021]2434号《关于准予银华华证 ESG 领先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《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 281,846,171.39 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1099 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 281,897,092.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 50,920.69 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票(包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券等及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、股票期权、现金及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金可以根据相关法律法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:华证 ESG 领先指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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》、《银华华证 ESG 领先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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对

在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利,H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册,H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	853,612.97
等于: 本金	853,420.21
加: 应计利息	192.76

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	853,612.97

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		10,901,666.60	-	12,886,906.72	1,985,240.12
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		10,901,666.60	-	12,886,906.72	1,985,240.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	885.70

其中：交易所市场	885.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	27,274.89
合计	28,166.17

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	11,628,685.46	11,628,685.46
本期申购	4,557,729.11	4,557,729.11
本期赎回（以“-”号填列）	-5,209,783.78	-5,209,783.78
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	10,976,630.79	10,976,630.79

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,227,470.44	-945,125.25	1,282,345.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,227,470.44	-945,125.25	1,282,345.19
本期利润	848,192.38	730,731.20	1,578,923.58
本期基金份额交易产生的变动数	-92,162.36	-70,821.69	-162,984.05
其中：基金申购款	1,077,080.58	-422,936.02	654,144.56
基金赎回款	-1,169,242.94	352,114.33	-817,128.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,983,500.46	-285,215.74	2,698,284.72

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	3,221.33
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	14.62
其他	194.07
合计	3,430.02

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	797,670.09
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	797,670.09

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	8,493,129.28
减：卖出股票成本总额	7,687,787.53
减：交易费用	7,671.66
买卖股票差价收入	797,670.09

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	112,779.40
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	112,779.40

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	730,731.20
股票投资	730,731.20
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	730,731.20

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	548.06
基金转换费收入	1.69
合计	549.75

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	2,479.70
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	0.18
合计	27,275.07

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西南证券	16,298,628.41	100.00	28,292,346.39	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
-------	----------------------------

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	2,378.55	100.00	885.70	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	4,128.35	100.00	2,770.60	100.00

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	32,468.23	122,010.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,924.10	13,726.31
应支付基金管理人的净管理费	24,544.13	108,284.58

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	6,493.58	24,402.14

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
银华长安资本 管理（北京） 有限公司	4,374,726.52	39.85	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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
中国邮政储蓄银行	853,612.97	3,221.33	3,354,678.24	11,641.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	93	16,679.55	81,796.29	-

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	853,612.97	-	-	-	853,612.97
结算备付金	35.23	-	-	-	35.23
存出保证金	3,778.68	-	-	-	3,778.68
交易性金融资产	-	-	-	12,886,906.72	12,886,906.72
应收申购款	-	-	-	1,592.15	1,592.15
资产总计	857,426.88	-	-	12,888,498.87	13,745,925.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,124.58	36,124.58
应付管理人报酬	-	-	-	5,599.58	5,599.58
应付托管费	-	-	-	1,119.90	1,119.90
应付清算款	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	28,166.17	28,166.17
负债总计	-	-	-	71,010.24	71,010.24
利率敏感度缺口	857,426.88	-	-	12,817,488.63	13,674,915.51
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	1,097,624.74	-	-	-	1,097,624.74
结算备付金	169.54	-	-	-	169.54
存出保证金	23,295.61	-	-	-	23,295.61
交易性金融资产	-	-	-	12,038,463.92	12,038,463.92
应收申购款	-	-	-	244.75	244.75
资产总计	1,121,089.89	-	-	12,038,708.67	13,159,798.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	179,724.27	179,724.27
应付管理人报酬	-	-	-	5,518.33	5,518.33

应付托管费	-	-	-	1,103.66	1,103.66
应付清算款	-	-	-	768.80	768.80
其他负债	-	-	-	61,652.85	61,652.85
负债总计	-	-	-	248,767.91	248,767.91
利率敏感度缺口	1,121,089.89	-	-	11,789,940.76	12,911,030.65

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	12,886,906.72	94.24	12,038,463.92	93.24
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	12,886,906.72	94.24	12,038,463.92	93.24

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%	676,403.74	638,855.67
	业绩比较基准下降 5%	-676,403.74	-638,855.67

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	12,805,110.43	11,969,794.00
第二层次	81,796.29	68,669.92

第三层次	-	-
合计	12,886,906.72	12,038,463.92

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	12,886,906.72	93.75
	其中：股票	12,886,906.72	93.75
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	853,648.20	6.21
8	其他各项资产	5,370.83	0.04
9	合计	13,745,925.75	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	52,485.00	0.38
B	采矿业	603,522.00	4.41
C	制造业	9,419,155.00	68.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	261,088.00	1.91
E	建筑业	89,265.00	0.65
F	批发和零售业	34,632.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	163,839.00	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	708,019.42	5.18
J	金融业	1,210,857.30	8.85
K	房地产业	60,494.00	0.44
L	租赁和商务服务业	65,667.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	193,621.00	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	3,612.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,650.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,886,906.72	94.24

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	300750	宁德时代	1,400	550,214.00	4.02
2	300308	中际旭创	400	508,000.00	3.71
3	600519	贵州茅台	300	355,647.00	2.60
4	603986	兆易创新	400	326,000.00	2.38
5	688256	寒武纪	200	319,110.00	2.33
6	002371	北方华创	285	252,099.60	1.84
7	688008	澜起科技	673	208,562.70	1.53
8	600036	招商银行	5,600	198,800.00	1.45
9	601899	紫金矿业	7,800	196,092.00	1.43
10	688981	中芯国际	1,176	186,772.32	1.37
11	002384	东山精密	700	183,645.00	1.34
12	600900	长江电力	6,600	174,702.00	1.28
13	000333	美的集团	2,300	173,719.00	1.27
14	000725	京东方 A	19,700	170,996.00	1.25
15	688012	中微公司	361	169,128.50	1.24
16	002475	立讯精密	2,400	168,960.00	1.24
17	603259	药明康德	1,300	161,863.00	1.18
18	601138	工业富联	2,200	158,730.00	1.16
19	600030	中信证券	5,350	153,705.50	1.12
20	601166	兴业银行	9,200	152,352.00	1.11
21	300059	东方财富	6,900	140,622.00	1.03
22	300274	阳光电源	800	127,216.00	0.93
23	600183	生益科技	700	121,380.00	0.89
24	300408	三环集团	700	116,830.00	0.85
25	601211	国泰海通	6,100	111,020.00	0.81
26	600276	恒瑞医药	2,100	109,284.00	0.80
27	002463	沪电股份	700	106,960.00	0.78
28	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.76
29	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.72
30	000988	华工科技	500	92,305.00	0.67
31	600522	中天科技	1,500	91,020.00	0.67
32	600584	长电科技	800	82,840.00	0.61
33	688072	拓荆科技	93	81,796.29	0.60
34	600887	伊利股份	3,400	81,464.00	0.60
35	000858	五 粮 液	1,100	81,400.00	0.60
36	600176	中国巨石	1,100	80,168.00	0.59
37	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.56
38	688521	芯原股份	193	71,630.02	0.52
39	000338	潍柴动力	2,600	70,850.00	0.52
40	600309	万华化学	1,000	68,410.00	0.50
41	002415	海康威视	2,000	68,400.00	0.50
42	300604	长川科技	200	68,284.00	0.50
43	600111	北方稀土	1,400	67,270.00	0.49

44	603993	洛阳钼业	3,800	66,690.00	0.49
45	300124	汇川技术	1,000	66,330.00	0.49
46	601688	华泰证券	3,200	65,984.00	0.48
47	000100	TCL 科技	11,300	65,766.00	0.48
48	688120	华海清科	192	61,858.56	0.45
49	000063	中兴通讯	1,700	61,523.00	0.45
50	600089	特变电工	2,700	60,750.00	0.44
51	000792	盐湖股份	2,000	60,380.00	0.44
52	300136	信维通信	500	59,625.00	0.44
53	300433	蓝思科技	1,100	59,026.00	0.43
54	601088	中国神华	1,500	58,560.00	0.43
55	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.40
56	000001	平安银行	5,300	53,265.00	0.39
57	002156	通富微电	700	53,109.00	0.39
58	002050	三花智控	1,200	52,596.00	0.38
59	002714	牧原股份	1,500	52,485.00	0.38
60	300014	亿纬锂能	800	52,024.00	0.38
61	002028	思源电气	300	51,900.00	0.38
62	600549	厦门钨业	600	51,120.00	0.37
63	601668	中国建筑	11,200	48,608.00	0.36
64	600031	三一重工	2,800	48,384.00	0.35
65	000657	中钨高新	500	47,860.00	0.35
66	603501	豪威集团	500	47,425.00	0.35
67	002916	深南电路	100	45,790.00	0.33
68	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.33
69	600660	福耀玻璃	900	45,396.00	0.33
70	601919	中远海控	3,400	45,084.00	0.33
71	601728	中国电信	8,400	43,596.00	0.32
72	601012	隆基绿能	3,300	43,296.00	0.32
73	601225	陕西煤业	2,100	42,735.00	0.31
74	688111	金山办公	200	42,610.00	0.31
75	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.31
76	600999	招商证券	2,000	42,200.00	0.31
77	002938	鹏鼎控股	400	42,152.00	0.31
78	000977	浪潮信息	600	42,000.00	0.31
79	002709	天赐材料	800	41,144.00	0.30
80	688777	中控技术	350	41,125.00	0.30
81	002230	科大讯飞	1,000	40,840.00	0.30
82	600690	海尔智家	2,000	40,820.00	0.30
83	300760	迈瑞医疗	300	40,749.00	0.30
84	600406	国电南瑞	1,780	40,673.00	0.30
85	002352	顺丰控股	1,300	40,638.00	0.30
86	601985	中国核电	4,500	40,635.00	0.30

87	605117	德业股份	380	40,348.40	0.30
88	002460	赣锋锂业	600	39,240.00	0.29
89	603799	华友钴业	800	38,608.00	0.28
90	000021	深科技	600	38,562.00	0.28
91	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.27
92	000776	广发证券	1,600	37,440.00	0.27
93	600160	巨化股份	700	37,107.00	0.27
94	002466	天齐锂业	600	36,792.00	0.27
95	000425	徐工机械	4,500	36,405.00	0.27
96	002080	中材科技	400	36,000.00	0.26
97	002202	金风科技	1,500	35,850.00	0.26
98	600938	中国海油	1,300	35,295.00	0.26
99	600028	中国石化	7,900	35,234.00	0.26
100	688249	晶合集成	589	34,768.67	0.25
101	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.25
102	002600	领益智造	2,000	34,680.00	0.25
103	000938	紫光股份	1,200	34,632.00	0.25
104	601766	中国中车	6,600	34,320.00	0.25
105	600050	中国联通	8,500	34,000.00	0.25
106	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.24
107	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.24
108	600460	士兰微	600	32,796.00	0.24
109	601872	招商轮船	1,800	31,626.00	0.23
110	002241	歌尔股份	1,400	31,542.00	0.23
111	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.23
112	603296	华勤技术	420	31,193.40	0.23
113	603288	海天味业	940	31,170.40	0.23
114	000568	泸州老窖	400	31,008.00	0.23
115	002179	中航光电	650	30,030.00	0.22
116	600498	烽火通信	400	29,440.00	0.22
117	688469	芯联集成	2,761	29,294.21	0.21
118	688396	华润微	298	29,069.90	0.21
119	600905	三峡能源	7,800	28,938.00	0.21
120	300661	圣邦股份	200	28,696.00	0.21
121	002273	水晶光电	800	28,384.00	0.21
122	601689	拓普集团	500	28,210.00	0.21
123	300390	天华新能	300	28,053.00	0.21
124	000630	铜陵有色	4,400	27,984.00	0.20
125	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.20
126	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.20
127	000408	藏格矿业	400	27,728.00	0.20
128	688271	联影医疗	273	27,635.79	0.20
129	601888	中国中免	500	26,855.00	0.20

130	002027	分众传媒	5,500	26,620.00	0.19
131	688183	生益电子	200	26,480.00	0.19
132	600958	东方证券	2,800	26,432.00	0.19
133	600362	江西铜业	600	25,980.00	0.19
134	603129	春风动力	100	25,580.00	0.19
135	600019	宝钢股份	4,700	25,521.00	0.19
136	600760	中航沈飞	600	24,660.00	0.18
137	601127	赛力斯	400	24,500.00	0.18
138	300450	先导智能	600	24,432.00	0.18
139	601168	西部矿业	900	24,426.00	0.18
140	600989	宝丰能源	1,200	24,396.00	0.18
141	000807	云铝股份	1,100	24,354.00	0.18
142	300316	晶盛机电	400	24,160.00	0.18
143	600392	盛和资源	800	23,816.00	0.17
144	601727	上海电气	3,400	23,800.00	0.17
145	001389	广合科技	100	23,725.00	0.17
146	600988	赤峰黄金	900	23,688.00	0.17
147	000538	云南白药	500	23,685.00	0.17
148	002738	中矿资源	400	23,596.00	0.17
149	600141	兴发集团	500	23,485.00	0.17
150	002422	科伦药业	600	23,112.00	0.17
151	600547	山东黄金	1,000	23,090.00	0.17
152	600875	东方电气	800	23,016.00	0.17
153	002001	新 和 成	800	22,736.00	0.17
154	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.17
155	601377	兴业证券	3,720	22,468.80	0.16
156	000831	中国稀土	400	22,196.00	0.16
157	600585	海螺水泥	1,300	22,035.00	0.16
158	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.16
159	600436	片仔癀	200	21,856.00	0.16
160	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.16
161	603228	景旺电子	300	21,723.00	0.16
162	601995	中金公司	600	21,690.00	0.16
163	601818	光大银行	7,500	21,675.00	0.16
164	002129	TCL 中环	1,800	21,636.00	0.16
165	600143	金发科技	1,400	21,630.00	0.16
166	000166	申万宏源	4,900	21,560.00	0.16
167	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.16
168	000960	锡业股份	500	21,345.00	0.16
169	002648	卫星化学	900	21,141.00	0.15
170	601179	中国西电	1,400	20,888.00	0.15
171	300015	爱尔眼科	2,500	20,650.00	0.15
172	601868	中国能建	7,600	20,292.00	0.15

173	600482	中国动力	600	19,680.00	0.14
174	600497	驰宏锌锗	1,600	19,376.00	0.14
175	000625	长安汽车	2,700	19,359.00	0.14
176	002532	天山铝业	1,800	19,314.00	0.14
177	688099	晶晨股份	186	19,139.40	0.14
178	600426	华鲁恒升	800	19,136.00	0.14
179	688169	石头科技	200	18,994.00	0.14
180	000157	中联重科	2,700	18,819.00	0.14
181	600895	张江高科	500	18,625.00	0.14
182	002340	格林美	2,800	18,508.00	0.14
183	600096	云天化	600	18,240.00	0.13
184	600438	通威股份	1,500	18,165.00	0.13
185	002236	大华股份	1,100	18,139.00	0.13
186	600048	保利发展	3,900	18,057.00	0.13
187	600188	兖矿能源	1,000	17,770.00	0.13
188	000783	长江证券	1,800	17,550.00	0.13
189	300759	康龙化成	600	17,358.00	0.13
189	603659	璞泰来	600	17,358.00	0.13
190	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.13
191	600570	恒生电子	800	16,952.00	0.12
192	688385	复旦微电	236	16,824.44	0.12
193	003816	中国广核	4,300	16,813.00	0.12
194	002074	国轩高科	600	16,506.00	0.12
195	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.12
196	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.12
197	600009	上海机场	700	16,170.00	0.12
198	600026	中远海能	900	16,146.00	0.12
199	601058	赛轮轮胎	1,400	16,142.00	0.12
200	600066	宇通客车	600	16,086.00	0.12
201	601788	光大证券	1,100	15,873.00	0.12
202	688122	西部超导	251	15,765.31	0.12
203	601108	财通证券	1,800	15,570.00	0.11
204	300339	润和软件	400	15,404.00	0.11
205	000975	山金国际	900	15,300.00	0.11
206	688387	信科移动	769	15,256.96	0.11
207	300207	欣旺达	800	15,192.00	0.11
208	601881	中国银河	1,200	15,084.00	0.11
209	601877	正泰电器	600	15,042.00	0.11
210	688036	传音控股	253	14,914.35	0.11
211	002601	龙佰集团	900	14,832.00	0.11
212	600219	南山铝业	3,700	14,763.00	0.11
213	002517	恺英网络	900	14,625.00	0.11
214	601066	中信建投	500	14,535.00	0.11

215	300347	泰格医药	300	14,400.00	0.11
216	002155	湖南黄金	600	14,322.00	0.10
217	600233	圆通速递	900	14,175.00	0.10
218	000963	华东医药	500	14,060.00	0.10
219	601958	金钼股份	500	14,055.00	0.10
220	300115	长盈精密	500	13,970.00	0.10
221	600839	四川长虹	2,000	13,960.00	0.10
222	688047	龙芯中科	88	13,610.96	0.10
223	000895	双汇发展	600	13,440.00	0.10
224	000661	长春高新	200	13,320.00	0.10
225	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.10
226	601231	环旭电子	400	12,960.00	0.09
227	001979	招商蛇口	2,000	12,860.00	0.09
228	000878	云南铜业	800	12,704.00	0.09
229	002444	巨星科技	400	12,440.00	0.09
230	689009	九号公司	324	12,360.60	0.09
231	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.09
232	300748	金力永磁	400	12,340.00	0.09
233	600109	国金证券	1,400	12,292.00	0.09
234	600415	小商品城	1,200	12,192.00	0.09
235	603979	金诚信	200	11,806.00	0.09
236	688599	天合光能	826	11,663.12	0.09
237	002487	大金重工	200	11,594.00	0.08
238	601615	明阳智能	1,000	11,570.00	0.08
239	002304	洋河股份	300	11,445.00	0.08
240	002078	太阳纸业	900	11,241.00	0.08
241	000002	万 科 A	3,700	10,952.00	0.08
242	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.08
243	600298	安琪酵母	300	10,860.00	0.08
244	601800	中国交建	1,900	10,849.00	0.08
245	600699	均胜电子	500	10,805.00	0.08
246	000728	国元证券	1,400	10,486.00	0.08
247	300866	安克创新	100	10,450.00	0.08
248	600600	青岛啤酒	200	10,446.00	0.08
249	688223	晶科能源	2,160	10,260.00	0.08
250	300628	亿联网络	300	10,146.00	0.07
251	603806	福斯特	600	10,074.00	0.07
252	603606	东方电缆	240	9,962.40	0.07
253	688187	时代电气	144	9,887.04	0.07
254	601618	中国中冶	3,900	9,516.00	0.07
255	603369	今世缘	400	9,484.00	0.07
256	600085	同仁堂	400	9,244.00	0.07
257	000617	中油资本	1,400	9,226.00	0.07

258	600061	国投资本	1,400	9,170.00	0.07
259	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.07
260	000786	北新建材	500	9,045.00	0.07
261	001203	大中矿业	300	8,985.00	0.07
262	300896	爱美客	100	8,720.00	0.06
263	601699	潞安环能	600	8,568.00	0.06
264	000999	华润三九	379	8,523.71	0.06
265	600845	宝信软件	500	8,315.00	0.06
266	300122	智飞生物	700	8,183.00	0.06
267	000729	燕京啤酒	800	8,104.00	0.06
268	601059	信达证券	500	8,095.00	0.06
269	600332	白云山	400	8,016.00	0.06
270	000596	古井贡酒	100	7,980.00	0.06
271	688472	阿特斯	722	7,812.04	0.06
272	002223	鱼跃医疗	300	7,698.00	0.06
273	002939	长城证券	900	7,506.00	0.05
274	002379	宏桥控股	500	7,385.00	0.05
275	002459	晶澳科技	900	7,290.00	0.05
276	300999	金龙鱼	300	6,978.00	0.05
277	000932	华菱钢铁	1,900	6,593.00	0.05
278	000987	越秀资本	800	6,256.00	0.05
279	688303	大全能源	355	6,187.65	0.05
280	300765	石药创新	200	5,446.00	0.04
281	688608	恒玄科技	32	5,350.08	0.04
282	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.04
283	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.04
284	688297	中无人机	112	4,653.60	0.03
285	600968	海油发展	1,100	3,663.00	0.03
286	600292	电投水电	300	3,612.00	0.03
287	601808	中海油服	300	3,243.00	0.02
288	601061	中信金属	300	3,231.00	0.02

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	300750	宁德时代	316,728.00	2.45
2	000333	美的集团	252,297.00	1.95
3	688256	寒武纪	241,822.00	1.87
4	002594	比亚迪	170,305.00	1.32
5	600519	贵州茅台	139,576.00	1.08

6	601318	中国平安	124,059.00	0.96
7	601899	紫金矿业	118,225.00	0.92
8	300308	中际旭创	109,196.00	0.85
9	002463	沪电股份	104,310.00	0.81
10	300408	三环集团	103,778.00	0.80
11	600036	招商银行	94,848.00	0.73
12	600900	长江电力	76,453.00	0.59
13	002230	科大讯飞	73,028.00	0.57
14	601166	兴业银行	71,326.00	0.55
15	002028	思源电气	70,040.00	0.54
16	002916	深南电路	64,784.00	0.50
17	300059	东方财富	62,176.00	0.48
18	600030	中信证券	59,759.00	0.46
19	300498	温氏股份	58,192.00	0.45
20	688041	海光信息	57,863.22	0.45

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	601318	中国平安	493,694.00	3.82
2	000333	美的集团	240,799.00	1.87
3	300750	宁德时代	234,767.00	1.82
4	688041	海光信息	208,863.78	1.62
5	601398	工商银行	176,350.00	1.37
6	300308	中际旭创	157,905.00	1.22
7	002594	比亚迪	155,470.00	1.20
8	601288	农业银行	150,102.00	1.16
9	601328	交通银行	145,211.00	1.12
10	600487	亨通光电	131,245.00	1.02
11	600919	江苏银行	130,540.00	1.01
12	601899	紫金矿业	124,018.00	0.96
13	600519	贵州茅台	122,358.00	0.95
14	300394	天孚通信	116,910.00	0.91
15	601857	中国石油	106,816.00	0.83
16	600000	浦发银行	100,924.00	0.78
17	600036	招商银行	97,725.00	0.76
18	601601	中国太保	90,683.00	0.70
19	002916	深南电路	84,545.00	0.65
20	601600	中国铝业	83,486.00	0.65

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	7,805,499.13
卖出股票收入（成交）总额	8,493,129.28

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	3,778.68

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,592.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,370.83

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 (%)
525	20,907.87	4,374,726.52	39.85	6,601,904.27	60.15

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 11 月 19 日）基金份 额总额	281,897,092.08
本报告期期初基金份额总额	11,628,685.46
本报告期基金总申购份额	4,557,729.11
减：本报告期基金总赎回份额	5,209,783.78
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	10,976,630.79

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

无。

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，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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 (%)	
西南证券	2	16,298,628.41	100.00	2,378.55	100.00	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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 (%)
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	《银华基金管理股份有限公司关于银华华证 ESG 领先指数证券投资基金投资关联方证券的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2026 年 1 月 9 日
2	《银华华证 ESG 领先指数证券投资基	本基金管理人网站, 中	2026 年 1 月 21 日

	金 2025 年第 4 季度报告》	国证监会基金电子披露网站	
3	《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
4	《银华基金管理股份有限公司关于银华旗下部分基金接受代销机构费率折扣申请的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 2 月 3 日
5	《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调整的公告》	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 21 日
6	《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金 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
7	《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
8	《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金 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
9	《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
10	《银华华证 ESG 领先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 6 月 17 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华华证 ESG 领先指数证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2026 年 6 月 17 日
12	《银华华证 ESG 领先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 6 月 17 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的拓荆科技估值方法调整的公告》	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 30 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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	20260312-20 260630	0.00	4,374,72 6.52	0.00	4,374,7 26.52	39.85
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，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 银华华证 ESG 领先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 《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华华证 ESG 领先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住所。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