

银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	57
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A500ETF
场内简称	A500ETF 银华
基金主代码	159339
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,838,086,841.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易场所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金标的指数为中证 A500 指数及其未来可能发生的变更。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	邱珂磊
	联系电话	(010)58163000	4008-888-108
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	service@csc.com.cn

客户服务电话	4006783333, (010)85186558	95587
传真	(010) 58163027	010-56162085
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码	100738	100020
法定代表人	王珠林	刘成

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	379,732,393.49
本期利润	342,249,974.12
加权平均基金份额本期利润	0.1648
本期加权平均净值利润率	13.08%
本期基金份额净值增长率	12.81%
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	576,672,316.19
期末可供分配基金份额利润	0.3137
期末基金资产净值	2,488,938,688.00
期末基金份额净值	1.3541
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	35.41%

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。

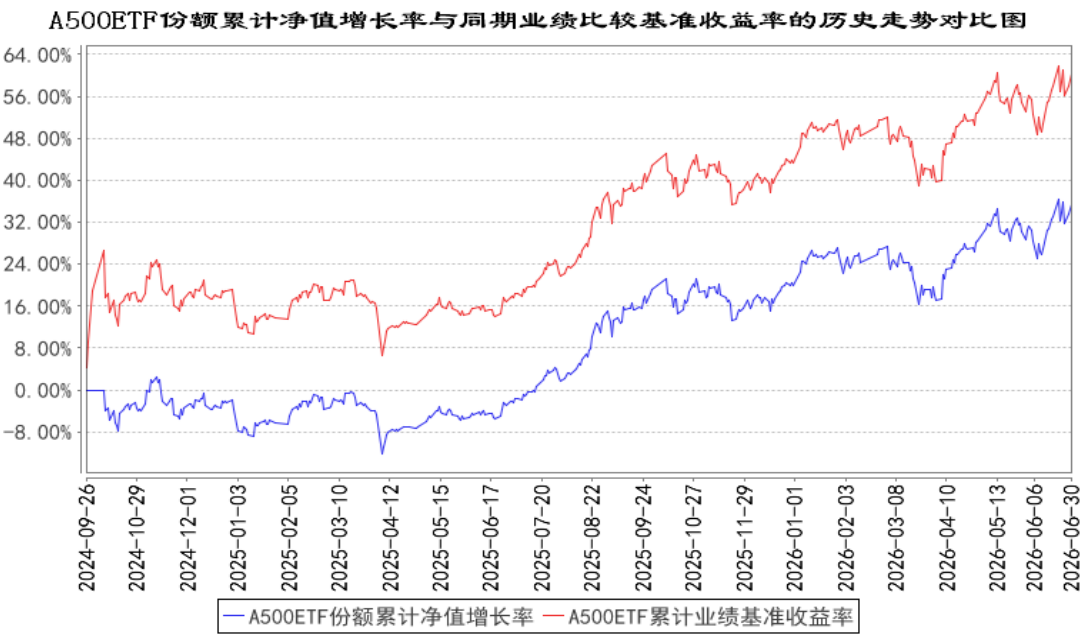
3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	15.09%	1.39%	14.26%	1.41%	0.83%	-0.02%
过去六个月	12.81%	1.28%	11.91%	1.29%	0.90%	-0.01%
过去一年	38.53%	1.14%	36.38%	1.14%	2.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	35.41%	1.15%	60.39%	1.35%	-24.98%	-0.20%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马君女士	本基金的基金经理	2024 年 9 月 26 日	-	17.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日至 2024 年 9 月 26 日兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自

				2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日至 2025 年 7 月 11 日兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 4 月 25 日至 2025 年 8 月 27 日兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2025 年 4 月 16 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自
--	--	--	--	---

					2026 年 4 月 29 日起兼任银华中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理	2024 年 9 月 26 日	-	14.5 年	学士学位。曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 12 月 29 日至 2023 年 10 月 24 日担任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、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 12 月 29 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 12 月 29 日至 2024 年 10 月 31 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 29 日至 2026 年 4 月 16 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日至 2023 年 10 月 24 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日至 2025 年 8 月 27 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 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基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日至 2024 年 11 月 14 日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 日起兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、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 12 月 29 日起兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日至 2024 年 7 月 30 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 20 日至 2026 年 6 月 14 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 2026 年 6 月 15 日起兼任银华创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经

					理，自 2024 年 1 月 9 日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 6 日至 2025 年 8 月 27 日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 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2024 年 12 月 24 日起兼任银华沪深 300 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 2025 年 1 月 6 日起兼任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基金经理，自 2025 年 3 月 11 日起兼任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基金经理，自 2026 年 3 月 25 日起兼任银华国证工业软件主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2026 年 4 月 23 日起兼任银华国证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2026 年 4 月 24 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 8 月 10 日起兼任银华中证云计算 50 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股份有限公司，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公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 1.3541 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.81%，业绩比较基准收益率为 11.91%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金过程中，

严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	45,740,306.11	40,081,005.12
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,464,113,569.37	3,236,335,576.85
其中：股票投资		2,464,113,569.37	3,236,335,576.85
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		1,056,206.51	6,443,769.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,510,910,081.99	3,282,860,351.76
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		21,335,437.09	10,019,551.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		274,169.44	379,084.09
应付托管费		91,389.82	126,361.36
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	270,397.64	225,060.00
负债合计		21,971,393.99	10,750,057.12
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	1,838,086,841.00	2,726,086,841.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	650,851,847.00	546,023,453.64
净资产合计		2,488,938,688.00	3,272,110,294.64
负债和净资产总计		2,510,910,081.99	3,282,860,351.76

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3541 元，基金份额总额 1,838,086,841.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		344,957,352.17	126,664,416.21
1. 利息收入		9,273.27	100,605.81

其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,273.27	100,605.81
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）		377,420,310.62	-19,922,335.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	356,552,146.33	-99,809,379.42
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	20,868,164.29	79,887,044.38
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	-37,482,419.37	135,059,821.05
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	5,010,187.65	11,426,324.39
减：二、营业总支出		2,707,378.05	7,960,672.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,952,431.13	5,886,822.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	650,810.38	1,962,274.18
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	104,136.54	111,575.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		342,249,974.12	118,703,743.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		342,249,974.12	118,703,743.99

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		342,249,974.12	118,703,743.99

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,726,086,841.00	-	546,023,453.64	3,272,110,294.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,726,086,841.00	-	546,023,453.64	3,272,110,294.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-888,000,000.00	-	104,828,393.36	-783,171,606.64
（一）、综合收益总额	-	-	342,249,974.12	342,249,974.12
（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）	-888,000,000.00	-	-237,421,580.76	-1,125,421,580.76
其中：1. 基金申购款	930,000,000.00	-	223,591,598.37	1,153,591,598.37
2. 基金赎回款	-1,818,000,000.00	-	-461,013,179.13	-2,279,013,179.13
（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	1,838,086,841.00	-	650,851,847.00	2,488,938,688.00
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	10,265,086,841.00	-	-383,330,658.66	9,881,756,182.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,265,086,841.00	-	-383,330,658.66	9,881,756,182.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,927,000,000.00	-	240,475,624.22	-3,686,524,375.78
（一）、综合收益总额	-	-	118,703,743.99	118,703,743.99
（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）	-3,927,000,000.00	-	121,771,880.23	-3,805,228,119.77
其中：1. 基金申购款	2,187,000,000.00	-	-128,060,078.94	2,058,939,921.06
2. 基金赎回款	-6,114,000,000.00	-	249,831,959.17	-5,864,168,040.83
（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	6,338,086,841.00	-	-142,855,034.44	6,195,231,806.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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[2024]1269 号文《关于准予银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 23 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2024）验字第 70026197_A10 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 9 月 26 日正式生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的 A500ETF 以网下现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 494,506.00 元，折合 494,506.00 份 A500ETF 基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的折份额的利息为人民币 35.00 元，折合 35.00 份 A500ETF 基金份额。A500ETF 以网上现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,999,505,457.00 元，折合 1,999,505,457.00 份 A500ETF 基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的折份额的利息为人民币 86,843.00 元，折合 86,843.00 份 A500ETF 基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 2,000,086,841.00 元，折合 2,000,086,841.00 份 A500ETF 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证，下同)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括主板股票、创业板股票、科创板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券（含分离交易可转债的纯债部分，下同）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行

存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例，新纳入的投资品种的投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金业绩比较基准：中证 A500 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	913,528.74
等于：本金	913,439.94
加：应计利息	88.80
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	44,826,777.37
等于：本金	44,826,222.60
加：应计利息	554.77
减：坏账准备	-
合计	45,740,306.11

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		2,064,201,327.82	-	2,464,113,569.37	399,912,241.55
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		2,064,201,327.82	-	2,464,113,569.37	399,912,241.55

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	194,136.54
其他	76,261.10

合计	270,397.64
----	------------

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	2,726,086,841.00	2,726,086,841.00
本期申购	930,000,000.00	930,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,818,000,000.00	-1,818,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,838,086,841.00	1,838,086,841.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	358,673,133.81	187,350,319.83	546,023,453.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	358,673,133.81	187,350,319.83	546,023,453.64
本期利润	379,732,393.49	-37,482,419.37	342,249,974.12
本期基金份额交易产生的变动数	-161,733,211.11	-75,688,369.65	-237,421,580.76
其中：基金申购款	215,043,779.16	8,547,819.21	223,591,598.37
基金赎回款	-376,776,990.27	-84,236,188.86	-461,013,179.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	576,672,316.19	74,179,530.81	650,851,847.00

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	1,703.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,569.51
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	9,273.27
----	----------

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	156,200,765.87
股票投资收益——赎回差价收入	200,351,380.46
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	356,552,146.33

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	1,445,435,106.16
减：卖出股票成本总额	1,288,029,985.99
减：交易费用	1,204,354.30
买卖股票差价收入	156,200,765.87

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,279,013,179.13
减：现金支付赎回款总额	1,282,480,327.13
减：赎回股票成本总额	796,181,471.54
减：交易费用	—
赎回差价收入	200,351,380.46

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	20,868,164.29
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	20,868,164.29

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	-37,482,419.37
股票投资	-37,482,419.37
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	-37,482,419.37

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	5,010,187.65
合计	5,010,187.65

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	9,916.99
合计	104,136.54

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人、基金代销机构
银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“银华中证 A500ETF 发起式联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,952,431.13	5,886,822.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	257,326.67	645,647.93
应支付基金管理人的净管理费	1,695,104.46	5,241,174.47

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 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%/ \text{当年天数}$$

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	650,810.38	1,962,274.18

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 0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%/ \text{当年天数}$$

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

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（%）
西南证券	-	-	42,890,904.00	1.57
银华中证 A500ETF 发起 式联接	381,325,132.00	20.75	665,671,134.00	24.42
中信建投	75,395,408.00	4.10	1,686,683.00	0.06

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
中信建投	913,528.74	1,703.76	1,569,878.22	2,623.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中信建投证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的招商银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人（中信建投证券股份有限公司）关联方发行的股票：中信证券（600030）727,600.00 股，期末公允价值为人民币 20,903,948.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.84%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

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	832.00	2026年7月13日	890.99	13,462	2,923,445.18	11,200,384.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,740,306.11	-	-	-	45,740,306.11
交易性金融资产	-	-	-	2,464,113,569.37	2,464,113,569.37
应收清算款	-	-	-	1,056,206.51	1,056,206.51
资产总计	45,740,306.11	-	-	2,465,169,775.88	2,510,910,081.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	274,169.44	274,169.44
应付托管费	-	-	-	91,389.82	91,389.82
应付清算款	-	-	-	21,335,437.09	21,335,437.09
其他负债	-	-	-	270,397.64	270,397.64
负债总计	-	-	-	21,971,393.99	21,971,393.99
利率敏感度缺口	45,740,306.11	-	-	2,443,198,381.89	2,488,938,688.00
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	40,081,005.12	-	-	-	40,081,005.12
交易性金融资产	-	-	-	3,236,335,576.85	3,236,335,576.85
应收清算款	-	-	-	6,443,769.79	6,443,769.79
资产总计	40,081,005.12	-	-	3,242,779,346.64	3,282,860,351.76
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	379,084.09	379,084.09
应付托管费	-	-	-	126,361.36	126,361.36
应付清算款	-	-	-	10,019,551.67	10,019,551.67
其他负债	-	-	-	225,060.00	225,060.00
负债总计	-	-	-	10,750,057.12	10,750,057.12
利率敏感度缺口	40,081,005.12	-	-	3,232,029,289.52	3,272,110,294.64

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

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	2,464,113,569.37	99.00	3,236,335,576.85	98.91
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	2,464,113,569.37	99.00	3,236,335,576.85	98.91

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%	123, 537, 835. 45	161, 990, 249. 54
	业绩比较基准下降 5%	-123, 537, 835. 45	-161, 990, 249. 54

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	2, 452, 755, 658. 63	3, 217, 705, 139. 85
第二层次	11, 200, 384. 00	18, 323, 823. 84
第三层次	157, 526. 74	306, 613. 16
合计	2, 464, 113, 569. 37	3, 236, 335, 576. 85

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、境内股票涨跌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	2,464,113,569.37	98.14
	其中：股票	2,464,113,569.37	98.14
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	45,740,306.11	1.82
8	其他各项资产	1,056,206.51	0.04
9	合计	2,510,910,081.99	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,690,089.00	0.31
B	采矿业	101,685,545.20	4.09
C	制造业	1,746,258,912.31	70.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,867,883.00	2.16
E	建筑业	30,197,950.00	1.21
F	批发和零售业	18,442,779.43	0.74

G	交通运输、仓储和邮政业	55,210,411.16	2.22
H	住宿和餐饮业	1,211,434.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,953,372.36	5.34
J	金融业	239,177,664.15	9.61
K	房地产业	13,698,974.40	0.55
L	租赁和商务服务业	17,698,113.04	0.71
M	科学研究和技术服务业	29,481,615.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	4,305,796.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	807,840.00	0.03
Q	卫生和社会工作	4,792,014.04	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,902,522.00	0.08
S	综合	4,552,332.00	0.18
	合计	2,463,935,247.09	99.00

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	155,943.28	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	157,526.74	0.01

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	300308	中际旭创	81,340	103,301,800.00	4.15
2	300750	宁德时代	195,820	76,959,218.20	3.09
3	300502	新易盛	105,256	63,890,392.00	2.57
4	600519	贵州茅台	47,710	56,559,727.90	2.27
5	603986	兆易创新	50,600	41,239,000.00	1.66
6	601318	中国平安	794,200	37,915,108.00	1.52
7	688256	寒武纪	21,522	34,339,427.10	1.38
8	600036	招商银行	921,500	32,713,250.00	1.31
9	601899	紫金矿业	1,227,000	30,846,780.00	1.24
10	002371	北方华创	34,565	30,574,816.40	1.23
11	688012	中微公司	61,320	28,728,420.00	1.15
12	000333	美的集团	362,697	27,394,504.41	1.10
13	688008	澜起科技	88,320	27,370,368.00	1.10
14	688041	海光信息	73,508	27,220,012.40	1.09
15	002475	立讯精密	378,500	26,646,400.00	1.07
16	002384	东山精密	97,600	25,605,360.00	1.03
17	600900	长江电力	911,400	24,124,758.00	0.97
18	688981	中芯国际	150,362	23,880,492.84	0.96
19	000725	京东方 A	2,705,200	23,481,136.00	0.94
20	603259	药明康德	184,200	22,934,742.00	0.92
21	601166	兴业银行	1,263,100	20,916,936.00	0.84
22	600030	中信证券	727,600	20,903,948.00	0.84
23	300059	东方财富	942,600	19,210,188.00	0.77
24	600183	生益科技	109,500	18,987,300.00	0.76
25	300274	阳光电源	109,000	17,333,180.00	0.70
26	600276	恒瑞医药	330,400	17,194,016.00	0.69
27	601398	工商银行	2,411,600	17,050,012.00	0.69
28	300408	三环集团	101,600	16,957,040.00	0.68

29	300476	胜宏科技	46,600	16,143,638.00	0.65
30	002594	比亚迪	199,800	15,924,060.00	0.64
31	600487	亨通光电	144,900	15,843,366.00	0.64
32	002463	沪电股份	102,000	15,585,600.00	0.63
33	601211	国泰海通	842,836	15,339,615.20	0.62
34	300394	天孚通信	49,668	15,033,510.24	0.60
35	000988	华工科技	73,200	13,513,452.00	0.54
36	600176	中国巨石	179,200	13,060,096.00	0.52
37	601288	农业银行	2,141,100	12,996,477.00	0.52
38	688498	源杰科技	6,826	12,873,836.00	0.52
39	601328	交通银行	1,990,300	12,797,629.00	0.51
40	688525	佰维存储	25,828	12,777,886.44	0.51
41	000651	格力电器	333,035	12,488,812.50	0.50
42	301308	江波龙	17,400	12,246,120.00	0.49
43	600522	中天科技	201,695	12,238,852.60	0.49
44	300604	长川科技	35,300	12,052,126.00	0.48
45	603019	中科曙光	109,600	11,752,408.00	0.47
46	600150	中国船舶	338,887	11,450,991.73	0.46
47	603993	洛阳钼业	652,100	11,444,355.00	0.46
48	600887	伊利股份	472,400	11,318,704.00	0.45
49	688072	拓荆科技	13,462	11,200,384.00	0.45
50	600584	长电科技	107,900	11,173,045.00	0.45
51	000338	潍柴动力	402,400	10,965,400.00	0.44
52	688521	芯原股份	28,851	10,707,760.14	0.43
53	000858	五 粮 液	142,687	10,558,838.00	0.42
54	601816	京沪高铁	2,186,100	9,903,033.00	0.40
55	002281	光迅科技	38,000	9,763,720.00	0.39
56	300857	协创数据	28,400	9,653,160.00	0.39
57	600309	万华化学	138,400	9,467,944.00	0.38
58	688347	华虹宏力	27,939	9,395,885.70	0.38
59	002415	海康威视	272,200	9,309,240.00	0.37
60	300124	汇川技术	139,600	9,259,668.00	0.37
61	002008	大族激光	61,200	9,186,732.00	0.37
62	600111	北方稀土	188,100	9,038,205.00	0.36
63	688120	华海清科	27,129	8,740,421.22	0.35
64	000063	中兴通讯	239,700	8,674,743.00	0.35
65	000100	TCL 科技	1,467,600	8,541,432.00	0.34
66	002916	深南电路	18,647	8,538,461.30	0.34
67	600000	浦发银行	991,200	8,534,232.00	0.34
68	300136	信维通信	71,200	8,490,600.00	0.34
69	600089	特变电工	375,700	8,453,250.00	0.34
70	601857	中国石油	966,200	8,386,616.00	0.34
71	002028	思源电气	47,500	8,217,500.00	0.33

72	601088	中国神华	202,800	7,917,312.00	0.32
73	300223	君正股份	31,500	7,840,350.00	0.32
74	300433	蓝思科技	146,049	7,836,989.34	0.31
75	600031	三一重工	440,370	7,609,593.60	0.31
76	300014	亿纬锂能	114,200	7,426,426.00	0.30
77	002050	三花智控	167,900	7,359,057.00	0.30
78	601601	中国太保	254,105	7,247,074.60	0.29
79	000001	平安银行	719,007	7,226,020.35	0.29
80	002353	杰瑞股份	47,000	7,167,500.00	0.29
81	000792	盐湖股份	237,200	7,161,068.00	0.29
82	002714	牧原股份	201,700	7,057,483.00	0.28
83	600549	厦门钨业	81,000	6,901,200.00	0.28
84	600406	国电南瑞	299,440	6,842,204.00	0.27
85	300475	香农芯创	22,600	6,780,000.00	0.27
86	002156	通富微电	88,200	6,691,734.00	0.27
87	601668	中国建筑	1,538,400	6,676,656.00	0.27
88	000657	中钨高新	67,300	6,441,956.00	0.26
89	002436	兴森科技	126,200	6,429,890.00	0.26
90	300760	迈瑞医疗	46,412	6,304,141.96	0.25
91	601919	中远海控	469,500	6,225,570.00	0.25
92	002602	世纪华通	438,300	6,180,030.00	0.25
93	601988	中国银行	1,069,250	6,116,110.00	0.25
94	300054	鼎龙股份	57,100	6,050,887.00	0.24
95	600660	福耀玻璃	119,700	6,037,668.00	0.24
96	601728	中国电信	1,156,100	6,000,159.00	0.24
97	603501	豪威集团	63,000	5,975,550.00	0.24
98	601225	陕西煤业	290,200	5,905,570.00	0.24
99	601012	隆基绿能	449,181	5,893,254.72	0.24
100	002230	科大讯飞	141,349	5,772,693.16	0.23
101	600690	海尔智家	281,600	5,747,456.00	0.23
102	600941	中国移动	66,700	5,744,871.00	0.23
103	002352	顺丰控股	178,900	5,592,414.00	0.22
104	601985	中国核电	612,900	5,534,487.00	0.22
105	002709	天赐材料	107,300	5,518,439.00	0.22
106	002938	鹏鼎控股	52,300	5,511,374.00	0.22
107	002851	麦格米特	32,900	5,500,222.00	0.22
108	603799	华友钴业	113,700	5,487,162.00	0.22
109	600160	巨化股份	102,100	5,412,321.00	0.22
110	002460	赣锋锂业	82,240	5,378,496.00	0.22
111	000977	浪潮信息	75,400	5,278,000.00	0.21
112	688777	中控技术	43,433	5,103,377.50	0.21
113	300442	润泽科技	61,100	5,075,577.00	0.20
114	300033	同花顺	20,620	4,969,420.00	0.20

115	300661	圣邦股份	34,590	4,962,973.20	0.20
116	300757	罗博特科	8,000	4,952,000.00	0.20
117	688126	沪硅产业	123,162	4,912,932.18	0.20
118	601600	中国铝业	593,101	4,875,290.22	0.20
119	000425	徐工机械	599,500	4,849,955.00	0.19
120	600938	中国海油	178,500	4,846,275.00	0.19
121	600028	中国石化	1,085,100	4,839,546.00	0.19
122	300346	南大光电	51,660	4,786,299.00	0.19
123	002202	金风科技	199,800	4,775,220.00	0.19
124	000938	紫光股份	164,300	4,741,698.00	0.19
125	601766	中国中车	907,200	4,717,440.00	0.19
126	600050	中国联通	1,162,500	4,650,000.00	0.19
127	002466	天齐锂业	75,700	4,641,924.00	0.19
128	600460	士兰微	84,700	4,629,702.00	0.19
129	002080	中材科技	50,900	4,581,000.00	0.18
130	002837	英维克	57,340	4,561,970.40	0.18
131	002049	紫光国微	51,400	4,561,750.00	0.18
132	300395	菲利华	33,700	4,506,701.00	0.18
133	002600	领益智造	259,000	4,491,060.00	0.18
134	601100	恒立液压	41,700	4,485,252.00	0.18
135	002179	中航光电	96,460	4,456,452.00	0.18
136	002138	顺络电子	60,100	4,393,310.00	0.18
137	002185	华天科技	196,900	4,392,839.00	0.18
138	601628	中国人寿	123,900	4,379,865.00	0.18
139	000568	泸州老窖	55,400	4,294,608.00	0.17
140	300567	精测电子	13,441	4,268,861.60	0.17
141	601872	招商轮船	241,000	4,234,370.00	0.17
142	605117	德业股份	39,752	4,220,867.36	0.17
143	300390	天华新能	44,700	4,179,897.00	0.17
144	600879	航天电子	195,700	4,166,453.00	0.17
145	002241	歌尔股份	184,900	4,165,797.00	0.17
146	002407	多氟多	82,863	4,162,208.49	0.17
147	603288	海天味业	124,239	4,119,765.24	0.17
148	601006	大秦铁路	889,400	4,100,134.00	0.16
149	000408	藏格矿业	58,600	4,062,152.00	0.16
150	601658	邮储银行	822,800	4,056,404.00	0.16
151	688002	睿创微纳	25,783	3,988,372.27	0.16
152	688469	芯联集成	374,367	3,972,033.87	0.16
153	600905	三峡能源	1,065,400	3,952,634.00	0.16
154	600489	中金黄金	218,700	3,947,535.00	0.16
155	002625	光启技术	127,600	3,868,832.00	0.16
156	600893	航发动力	100,900	3,868,506.00	0.16
157	601888	中国中免	71,644	3,847,999.24	0.15

158	300037	新宙邦	41,100	3,816,135.00	0.15
159	600673	东阳光	112,900	3,791,182.00	0.15
160	000630	铜陵有色	594,984	3,784,098.24	0.15
161	600010	包钢股份	1,688,900	3,766,247.00	0.15
162	600118	中国卫星	45,500	3,733,275.00	0.15
163	601127	赛力斯	60,700	3,717,875.00	0.15
164	300058	蓝色光标	264,680	3,641,996.80	0.15
165	688017	绿的谐波	8,713	3,640,814.18	0.15
166	601689	拓普集团	64,400	3,633,448.00	0.15
167	002027	分众传媒	741,900	3,590,796.00	0.14
168	688396	华润微	36,490	3,559,599.50	0.14
169	600019	宝钢股份	652,200	3,541,446.00	0.14
170	000426	兴业银锡	106,700	3,516,832.00	0.14
171	002273	水晶光电	98,277	3,486,867.96	0.14
172	000807	云铝股份	157,200	3,480,408.00	0.14
173	688271	联影医疗	34,064	3,448,298.72	0.14
174	600760	中航沈飞	82,800	3,403,080.00	0.14
175	688111	金山办公	15,875	3,382,168.75	0.14
176	600989	宝丰能源	165,800	3,370,714.00	0.14
177	601168	西部矿业	124,000	3,365,360.00	0.14
178	600104	上汽集团	344,600	3,363,296.00	0.14
179	601727	上海电气	471,600	3,301,200.00	0.13
180	600362	江西铜业	76,100	3,295,130.00	0.13
181	600875	东方电气	114,400	3,291,288.00	0.13
182	002001	新 和 成	115,088	3,270,800.96	0.13
183	600885	宏发股份	94,672	3,265,237.28	0.13
184	605589	圣泉集团	51,300	3,261,141.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	123,900	3,261,048.00	0.13
186	300450	先导智能	80,000	3,257,600.00	0.13
187	300751	迈为股份	11,500	3,248,290.00	0.13
188	600667	太极实业	110,100	3,212,718.00	0.13
189	601390	中国中铁	764,700	3,188,799.00	0.13
190	600392	盛和资源	105,800	3,149,666.00	0.13
191	002126	银轮股份	63,000	3,137,400.00	0.13
192	300782	卓胜微	28,600	3,133,988.00	0.13
193	000538	云南白药	65,995	3,126,183.15	0.13
194	600795	国电电力	666,400	3,112,088.00	0.13
195	000831	中国稀土	55,800	3,096,342.00	0.12
196	600547	山东黄金	133,700	3,087,133.00	0.12
197	000960	锡业股份	72,300	3,086,487.00	0.12
198	002422	科伦药业	79,700	3,070,044.00	0.12
199	002738	中矿资源	51,800	3,055,682.00	0.12
200	600418	江淮汽车	118,000	3,047,940.00	0.12

201	600585	海螺水泥	179,400	3,040,830.00	0.12
202	002812	恩捷股份	45,300	3,031,023.00	0.12
203	601669	中国电建	644,700	3,030,090.00	0.12
204	300316	晶盛机电	49,900	3,013,960.00	0.12
205	301358	湖南裕能	39,600	3,004,452.00	0.12
206	688099	晶晨股份	28,972	2,981,218.80	0.12
207	600096	云天化	97,300	2,957,920.00	0.12
208	002648	卫星化学	125,196	2,940,854.04	0.12
209	600141	兴发集团	62,400	2,930,928.00	0.12
210	300015	爱尔眼科	348,800	2,881,088.00	0.12
211	002129	TCL 中环	237,692	2,857,057.84	0.11
212	601179	中国西电	190,100	2,836,292.00	0.11
213	600346	恒力石化	159,600	2,826,516.00	0.11
214	601868	中国能建	1,041,300	2,780,271.00	0.11
215	002558	巨人网络	100,700	2,775,292.00	0.11
216	002195	岩山科技	422,600	2,763,804.00	0.11
217	600497	驰宏锌锗	227,200	2,751,392.00	0.11
218	300803	指南针	29,900	2,740,933.00	0.11
219	600482	中国动力	82,700	2,712,560.00	0.11
220	000066	中国长城	142,100	2,707,005.00	0.11
221	600066	宇通客车	100,700	2,699,767.00	0.11
222	300418	昆仑万维	66,600	2,687,976.00	0.11
223	600426	华鲁恒升	111,300	2,662,296.00	0.11
224	600580	卧龙电驱	79,800	2,641,380.00	0.11
225	600157	永泰能源	1,632,800	2,628,808.00	0.11
226	000625	长安汽车	365,300	2,619,201.00	0.11
227	600221	海航控股	1,919,500	2,591,325.00	0.10
228	002532	天山铝业	241,000	2,585,930.00	0.10
229	000157	中联重科	367,590	2,562,102.30	0.10
230	600895	张江高科	68,700	2,559,075.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	230,900	2,532,973.00	0.10
232	002340	格林美	379,400	2,507,834.00	0.10
233	000933	神火股份	117,700	2,495,240.00	0.10
234	600143	金发科技	161,300	2,492,085.00	0.10
235	600048	保利发展	536,500	2,483,995.00	0.10
236	600011	华能国际	326,600	2,478,894.00	0.10
237	300438	鹏辉能源	29,200	2,419,220.00	0.10
238	600438	通威股份	199,500	2,415,945.00	0.10
239	300017	网宿科技	185,600	2,414,656.00	0.10
240	600115	中国东航	632,800	2,410,968.00	0.10
241	600570	恒生电子	113,600	2,407,184.00	0.10
242	002493	荣盛石化	223,600	2,403,700.00	0.10
243	002131	利欧股份	503,500	2,391,625.00	0.10

244	002236	大华股份	144,400	2,381,156.00	0.10
245	600886	国投电力	178,800	2,379,828.00	0.10
246	002456	欧菲光	249,800	2,363,108.00	0.09
247	601233	桐昆股份	107,900	2,336,035.00	0.09
248	600352	浙江龙盛	192,800	2,334,808.00	0.09
249	688036	传音控股	39,350	2,319,682.50	0.09
250	605499	东鹏饮料	18,630	2,299,500.90	0.09
251	300339	润和软件	59,500	2,291,345.00	0.09
252	600436	片仔癀	20,700	2,262,096.00	0.09
253	603659	璞泰来	78,100	2,259,433.00	0.09
254	601058	赛轮轮胎	195,500	2,254,115.00	0.09
255	601360	三六零	259,200	2,252,448.00	0.09
256	003816	中国广核	574,900	2,247,859.00	0.09
257	600026	中远海能	124,200	2,228,148.00	0.09
258	000301	东方盛虹	193,900	2,220,155.00	0.09
259	002821	凯莱英	13,700	2,219,400.00	0.09
260	600009	上海机场	95,300	2,201,430.00	0.09
261	002555	三七互娱	115,900	2,187,033.00	0.09
262	300759	康龙化成	75,500	2,184,215.00	0.09
263	600196	复星医药	97,200	2,184,084.00	0.09
264	002074	国轩高科	79,100	2,176,041.00	0.09
265	002472	双环传动	51,500	2,137,765.00	0.09
266	688047	龙芯中科	13,811	2,136,147.37	0.09
267	000768	中航西飞	104,224	2,134,507.52	0.09
268	601111	中国国航	348,500	2,108,425.00	0.08
269	300001	特锐德	55,500	2,099,565.00	0.08
270	000975	山金国际	123,200	2,094,400.00	0.08
271	300207	欣旺达	109,800	2,085,102.00	0.08
272	002595	豪迈科技	44,720	2,083,952.00	0.08
273	600029	南方航空	401,800	2,081,324.00	0.08
274	300458	全志科技	52,533	2,072,952.18	0.08
275	688213	思特威	19,333	2,069,984.31	0.08
276	002517	恺英网络	127,200	2,067,000.00	0.08
277	600415	小商品城	203,000	2,062,480.00	0.08
278	601186	中国铁建	345,000	2,052,750.00	0.08
279	600219	南山铝业	512,000	2,042,880.00	0.08
280	002601	龙佰集团	123,800	2,040,224.00	0.08
281	600674	川投能源	143,900	2,039,063.00	0.08
282	688578	艾力斯	18,494	2,019,544.80	0.08
283	601117	中国化学	273,700	2,011,695.00	0.08
284	688235	百济神州	7,870	2,003,780.70	0.08
285	301236	软通动力	47,200	2,003,640.00	0.08
286	600233	圆通速递	126,900	1,998,675.00	0.08

287	002128	电投能源	85,900	1,986,008.00	0.08
288	601877	正泰电器	78,700	1,973,009.00	0.08
289	300115	长盈精密	70,300	1,964,182.00	0.08
290	600372	中航机载	180,600	1,959,510.00	0.08
291	688122	西部超导	31,197	1,959,483.57	0.08
292	600839	四川长虹	278,000	1,940,440.00	0.08
293	300347	泰格医药	40,100	1,924,800.00	0.08
294	300568	星源材质	102,100	1,911,312.00	0.08
295	002155	湖南黄金	79,660	1,901,484.20	0.08
296	603129	春风动力	7,400	1,892,920.00	0.08
297	300496	中科创达	30,400	1,878,416.00	0.08
298	000547	航天发展	97,500	1,867,125.00	0.08
299	002465	海格通信	146,100	1,865,697.00	0.07
300	300024	机器人	95,300	1,842,149.00	0.07
301	600741	华域汽车	118,300	1,836,016.00	0.07
302	000963	华东医药	65,000	1,827,800.00	0.07
303	002130	沃尔核材	96,200	1,823,952.00	0.07
304	300474	景嘉微	30,000	1,814,400.00	0.07
305	603979	金诚信	30,600	1,806,318.00	0.07
306	000733	振华科技	31,600	1,789,824.00	0.07
307	601021	春秋航空	38,600	1,759,388.00	0.07
308	002756	永兴材料	30,700	1,738,848.00	0.07
309	300012	华测检测	125,300	1,736,658.00	0.07
310	000878	云南铜业	108,900	1,729,332.00	0.07
311	300454	深信服	17,800	1,712,360.00	0.07
312	002497	雅化集团	84,000	1,711,080.00	0.07
313	001979	招商蛇口	264,400	1,700,092.00	0.07
314	688506	百利天恒	5,759	1,693,318.77	0.07
315	300083	创世纪	124,300	1,692,966.00	0.07
316	002414	高德红外	126,951	1,683,370.26	0.07
317	002271	东方雨虹	141,500	1,679,605.00	0.07
318	002444	巨星科技	54,000	1,679,400.00	0.07
319	000034	神州数码	60,480	1,678,320.00	0.07
320	603087	甘李药业	29,500	1,674,420.00	0.07
321	300073	当升科技	34,800	1,671,792.00	0.07
322	002920	德赛西威	20,500	1,670,750.00	0.07
323	603650	彤程新材	17,000	1,665,660.00	0.07
324	000423	东阿阿胶	35,800	1,623,888.00	0.07
325	300919	中伟新材	37,100	1,623,125.00	0.07
326	603606	东方电缆	39,000	1,618,890.00	0.07
327	601319	中国人保	237,800	1,607,528.00	0.06
328	300748	金力永磁	51,832	1,599,017.20	0.06
329	688676	金盘科技	18,815	1,592,501.60	0.06

330	688331	荣昌生物	12,174	1,585,785.24	0.06
331	002432	九安医疗	22,400	1,583,232.00	0.06
332	601677	明泰铝业	94,800	1,573,680.00	0.06
333	600699	均胜电子	71,900	1,553,759.00	0.06
334	002078	太阳纸业	124,400	1,553,756.00	0.06
335	300142	沃森生物	119,500	1,552,305.00	0.06
336	601615	明阳智能	133,900	1,549,223.00	0.06
337	300866	安克创新	14,800	1,546,600.00	0.06
338	300432	富临精工	75,400	1,514,786.00	0.06
339	600039	四川路桥	193,000	1,509,260.00	0.06
340	601800	中国交建	264,200	1,508,582.00	0.06
341	600226	亨通股份	156,600	1,501,794.00	0.06
342	688599	天合光能	106,247	1,500,207.64	0.06
343	000661	长春高新	22,500	1,498,500.00	0.06
344	002252	上海莱士	343,800	1,492,092.00	0.06
345	300763	锦浪科技	16,500	1,490,775.00	0.06
346	688266	泽璟制药	12,588	1,468,516.08	0.06
347	688223	晶科能源	306,260	1,454,735.00	0.06
348	601633	长城汽车	95,500	1,441,095.00	0.06
349	600588	用友网络	155,800	1,430,244.00	0.06
350	002831	裕同科技	40,200	1,429,512.00	0.06
351	000002	万科A	481,800	1,426,128.00	0.06
352	002025	航天电器	18,700	1,425,314.00	0.06
353	603260	合盛硅业	29,400	1,418,844.00	0.06
354	300677	英科医疗	36,100	1,414,037.00	0.06
355	002064	华峰化学	145,900	1,384,591.00	0.06
356	001965	招商公路	150,801	1,381,337.16	0.06
357	688608	恒玄科技	8,154	1,363,267.26	0.05
358	002294	信立泰	42,600	1,358,514.00	0.05
359	300724	捷佳伟创	19,200	1,355,520.00	0.05
360	688169	石头科技	14,200	1,348,574.00	0.05
361	300832	新产业	32,000	1,344,000.00	0.05
362	000786	北新建材	73,900	1,336,851.00	0.05
363	300342	天银机电	28,400	1,334,800.00	0.05
364	000519	中兵红箭	62,300	1,312,661.00	0.05
365	600177	雅戈尔	173,500	1,306,455.00	0.05
366	601618	中国中冶	534,400	1,303,936.00	0.05
367	600516	方大炭素	209,200	1,290,764.00	0.05
368	300699	光威复材	45,000	1,289,250.00	0.05
369	603806	福斯特	76,700	1,287,793.00	0.05
370	002176	江特电机	127,600	1,277,276.00	0.05
371	605090	九丰能源	34,200	1,271,214.00	0.05
372	601607	上海医药	81,700	1,258,180.00	0.05

373	688390	固德威	11,587	1,257,305.37	0.05
374	002085	万丰奥威	112,400	1,246,516.00	0.05
375	688180	君实生物	36,840	1,245,928.80	0.05
376	002318	久立特材	52,000	1,242,800.00	0.05
377	000617	中油资本	188,100	1,239,579.00	0.05
378	000623	吉林敖东	69,300	1,228,689.00	0.05
379	300251	光线传媒	110,100	1,221,009.00	0.05
380	600085	同仁堂	52,100	1,204,031.00	0.05
381	688188	柏楚电子	11,254	1,200,801.80	0.05
382	603596	伯特利	48,032	1,193,114.88	0.05
383	002065	东华软件	166,800	1,190,952.00	0.05
384	002223	鱼跃医疗	46,300	1,188,058.00	0.05
385	002459	晶澳科技	146,600	1,187,460.00	0.05
386	002266	浙富控股	234,400	1,186,064.00	0.05
387	688472	阿特斯	109,278	1,182,387.96	0.05
388	002044	美年健康	234,700	1,180,541.00	0.05
389	302132	中航成飞	20,200	1,178,064.00	0.05
390	688065	凯赛生物	24,531	1,173,808.35	0.05
391	300003	乐普医疗	98,800	1,170,780.00	0.05
392	300972	万辰集团	6,743	1,169,303.63	0.05
393	600515	海南机场	426,400	1,168,336.00	0.05
394	000032	深桑达 A	46,800	1,167,660.00	0.05
395	300409	道氏技术	58,500	1,165,905.00	0.05
396	000400	许继电气	53,700	1,165,290.00	0.05
397	600499	科达制造	84,100	1,160,580.00	0.05
398	002405	四维图新	177,300	1,147,131.00	0.05
399	000999	华润三九	50,700	1,140,243.00	0.05
400	000415	渤海租赁	278,600	1,133,902.00	0.05
401	300558	贝达药业	17,400	1,132,218.00	0.05
402	600862	中航高科	62,400	1,125,072.00	0.05
403	601216	君正集团	251,000	1,119,460.00	0.04
404	000683	博源化工	194,200	1,118,592.00	0.04
405	603766	隆鑫通用	93,600	1,116,648.00	0.04
406	600521	华海药业	77,400	1,114,560.00	0.04
407	600704	物产中大	233,600	1,102,592.00	0.04
408	000039	中集集团	134,200	1,088,362.00	0.04
409	600803	新奥股份	68,800	1,087,040.00	0.04
410	600018	上港集团	228,000	1,076,160.00	0.04
411	600312	平高电气	60,900	1,075,494.00	0.04
412	600332	白云山	53,200	1,066,128.00	0.04
413	000887	中鼎股份	59,400	1,062,666.00	0.04
414	301550	斯菱智驱	11,600	1,060,588.00	0.04
415	600323	瀚蓝环境	38,500	1,057,210.00	0.04

416	688617	惠泰医疗	5,768	1,047,238.08	0.04
417	688005	容百科技	34,180	1,045,908.00	0.04
418	600166	福田汽车	354,500	1,031,595.00	0.04
419	600153	建发股份	129,800	1,029,314.00	0.04
420	000967	盈峰环境	97,347	1,025,063.91	0.04
421	600765	中航重机	79,300	1,024,556.00	0.04
422	300122	智飞生物	87,000	1,017,030.00	0.04
423	000830	鲁西化工	83,800	1,005,600.00	0.04
424	002410	广联达	122,480	999,436.80	0.04
425	603605	珀莱雅	16,400	982,688.00	0.04
426	002007	华兰生物	79,500	969,105.00	0.04
427	688116	天奈科技	25,356	968,599.20	0.04
428	600316	洪都航空	34,400	961,136.00	0.04
429	603568	伟明环保	61,300	942,794.00	0.04
430	600398	海澜之家	179,200	937,216.00	0.04
431	600529	山东药玻	50,600	933,570.00	0.04
432	002603	以岭药业	62,100	931,500.00	0.04
433	601000	唐山港	224,300	930,845.00	0.04
434	002389	航天彩虹	52,200	927,594.00	0.04
435	601018	宁波港	290,800	916,020.00	0.04
436	000738	航发控制	50,000	914,500.00	0.04
437	688009	中国通号	191,870	913,301.20	0.04
438	300896	爱美客	10,412	907,926.40	0.04
439	600208	衢州发展	318,900	902,487.00	0.04
440	600008	首创环保	327,400	890,528.00	0.04
441	600170	上海建工	400,500	889,110.00	0.04
442	601799	星宇股份	9,800	888,076.00	0.04
443	688114	华大智造	17,262	881,742.96	0.04
444	600998	九州通	187,900	881,251.00	0.04
445	000932	华菱钢铁	250,400	868,888.00	0.03
446	600820	隧道股份	166,300	866,423.00	0.03
447	603816	顾家家居	38,600	863,096.00	0.03
448	601238	广汽集团	167,700	851,916.00	0.03
449	600486	扬农化工	16,800	851,760.00	0.03
450	600038	中直股份	33,300	842,157.00	0.03
451	600161	天坛生物	72,700	841,866.00	0.03
452	300118	东方日升	67,400	839,130.00	0.03
453	603392	万泰生物	30,900	833,373.00	0.03
454	603939	益丰药房	46,300	832,474.00	0.03
455	603885	吉祥航空	79,900	822,171.00	0.03
456	603486	科沃斯	16,100	817,075.00	0.03
457	002607	中公教育	448,800	807,840.00	0.03
458	600511	国药股份	30,800	802,032.00	0.03

459	601567	三星电气	52,800	788,832.00	0.03
460	300100	双林股份	28,200	783,396.00	0.03
461	688303	大全能源	44,283	771,852.69	0.03
462	601880	辽港股份	551,600	761,208.00	0.03
463	000833	粤桂股份	32,500	761,150.00	0.03
464	600535	天士力	56,600	748,818.00	0.03
465	688166	博瑞医药	21,156	740,671.56	0.03
466	600763	通策医疗	21,558	730,385.04	0.03
467	002244	滨江集团	95,500	725,800.00	0.03
468	600816	建元信托	296,200	722,728.00	0.03
469	300049	福瑞医科	18,200	707,616.00	0.03
470	300573	兴齐眼药	17,227	702,172.52	0.03
471	300676	华大基因	20,000	701,200.00	0.03
472	002120	韵达股份	109,400	695,784.00	0.03
473	002544	普天科技	38,100	694,182.00	0.03
474	300144	宋城演艺	117,300	681,513.00	0.03
475	601155	新城控股	66,400	681,264.00	0.03
476	300457	赢合科技	31,700	668,236.00	0.03
477	600754	锦江酒店	36,200	651,238.00	0.03
478	601866	中远海发	291,200	643,552.00	0.03
479	600064	南京高科	88,800	633,144.00	0.03
480	000998	隆平高科	83,900	632,606.00	0.03
481	688063	派能科技	11,842	630,823.34	0.03
482	603899	晨光股份	30,300	625,089.00	0.03
483	600635	大众公用	144,600	618,888.00	0.02
484	000035	中国天楹	124,900	603,267.00	0.02
485	600655	豫园股份	144,500	593,895.00	0.02
486	300601	康泰生物	51,100	579,474.00	0.02
487	600258	首旅酒店	51,300	560,196.00	0.02
488	600004	白云机场	75,500	548,130.00	0.02
489	600859	王府井	59,500	546,210.00	0.02
490	600663	陆家嘴	86,300	541,964.00	0.02
491	002091	江苏国泰	72,460	523,885.80	0.02
492	300070	碧水源	161,900	516,461.00	0.02
493	600864	哈投股份	95,300	494,607.00	0.02
494	000069	华侨城 A	297,510	487,916.40	0.02
495	301078	孩子王	66,100	446,836.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	66,100	433,616.00	0.02
497	600325	华发股份	168,300	388,773.00	0.02
498	603833	欧派家居	12,600	379,386.00	0.02
499	002891	中宠股份	13,600	363,392.00	0.01
500	002572	索菲亚	44,500	324,850.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
2	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
3	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
4	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
5	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
6	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
7	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
8	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
9	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
10	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
11	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	51,050,783.50	1.56
2	688041	海光信息	25,798,992.76	0.79
3	601318	中国平安	23,091,757.73	0.71
4	601899	紫金矿业	20,152,352.00	0.62
5	600036	招商银行	19,101,974.00	0.58
6	688008	澜起科技	16,256,395.74	0.50
7	603986	兆易创新	15,006,157.50	0.46
8	688981	中芯国际	13,324,243.63	0.41
9	600900	长江电力	12,621,686.00	0.39
10	601166	兴业银行	11,985,316.29	0.37
11	002371	北方华创	10,398,592.10	0.32
12	600276	恒瑞医药	10,176,850.00	0.31
13	600183	生益科技	10,046,443.00	0.31
14	600030	中信证券	9,886,721.35	0.30
15	688498	源杰科技	9,731,980.94	0.30
16	603259	药明康德	9,404,257.00	0.29
17	601398	工商银行	9,312,970.00	0.28
18	301308	江波龙	8,904,705.00	0.27
19	300394	天孚通信	8,885,698.00	0.27
20	688012	中微公司	8,270,415.75	0.25

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	600519	贵州茅台	84,585,430.06	2.59
2	601318	中国平安	50,028,491.85	1.53
3	601899	紫金矿业	44,090,479.30	1.35
4	600036	招商银行	38,362,468.15	1.17
5	688041	海光信息	33,449,330.23	1.02
6	600900	长江电力	25,357,217.42	0.77
7	601166	兴业银行	24,793,341.04	0.76
8	688981	中芯国际	22,407,637.95	0.68
9	688008	澜起科技	22,160,644.80	0.68
10	600276	恒瑞医药	20,433,679.07	0.62
11	603986	兆易创新	20,218,981.64	0.62
12	600030	中信证券	20,134,630.50	0.62
13	603259	药明康德	18,766,948.12	0.57
14	601398	工商银行	18,668,490.00	0.57
15	688256	寒武纪	16,609,585.50	0.51
16	601211	国泰海通	15,882,950.54	0.49
17	601288	农业银行	15,166,060.00	0.46
18	601328	交通银行	14,218,917.00	0.43
19	601088	中国神华	13,915,223.02	0.43
20	603993	洛阳钼业	13,619,711.00	0.42

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	848,152,940.38
卖出股票收入（成交）总额	1,445,435,106.16

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	—
2	应收清算款	1,056,206.51
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,056,206.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688635	长进光子	39,448.32	0.00	新股流通受限
2	603459	红板科技	27,825.60	0.00	新股流通受限
3	301696	三瑞智能	18,748.80	0.00	新股流通受限
4	301531	春光集团	14,952.40	0.00	新股流通受限
5	301599	理奇智能	14,059.51	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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（%）
11,366	161,718.00	1,481,957,749.00	80.63	356,129,092.00	19.37

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中信建投证券股份有限公司—银华中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	381,325,132.00	20.75

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（2024 年 9 月 26 日）基金份额总额	2,000,086,841.00
本报告期期初基金份额总额	2,726,086,841.00
本报告期基金总申购份额	930,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,818,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,838,086,841.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2026 年 1 月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

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：本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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 (%)	
广发证券	5	2,293,015,303.85	100.00	334,550.27	100.00	-

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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 1 月 21 日
3	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2026 年 3 月 27 日

	新》	网站	
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 变更场内简称、扩位简称的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2026 年 3 月 27 日
5	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 28 日
6	《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
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 4 月 15 日
8	《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 21 日
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	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2026 年 6 月 5 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	20260122-20260322	462, 783, 173.00	0.00	37, 000, 000.00	425, 783, 173.00	23.16
	1	20260325-20260630	462, 783, 173.00	0.00	37, 000, 000.00	425, 783, 173.00	23.16
	2	20260101-20260630	665, 671, 134.00	153, 787, 298.00	438, 133, 300.00	381, 325, 132.00	20.75
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 银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2026 年 8 月 29 日