银华创业板综合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：中国银行股份有限公司

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遵规守信情况的说明 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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 33

7.1 期末基金资产组合情况 33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 33
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 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48

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 48
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 48
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 48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 49
7.12 投资组合报告附注 49

§8 基金份额持有人信息 49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
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 50

§9 开放式基金份额变动 50

§10 重大事件揭示 50

10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 51
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 51
10.8 其他重大事件 52

§11 影响投资者决策的其他重要信息 53

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 53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 53

§12 备查文件目录 53

12.1 备查文件目录 53
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创业板综 ETF 银华
场内简称	创业板综 ETF 银华
基金主代码	159288
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 17 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	84,174,931.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 9 月 26 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。
投资策略	本基金主要采取最优化抽样复制标的指数的策略。最优化抽样依托量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。 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、股票期权合约和国债期货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	创业板综合指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，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，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	许俊
	联系电话	(010)58163000	010-66596688
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95566
传真		(010)58163027	010-66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100738	100818
法定代表人	王珠林	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	41,499,144.81
本期利润	38,904,160.15
加权平均基金份额本期利润	0.2239
本期加权平均净值利润率	20.86%
本期基金份额净值增长率	18.60%
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	15,694,139.23
期末可供分配基金份额利润	0.1864
期末基金资产净值	99,869,070.23
期末基金份额净值	1.1864
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	18.64%

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	20.15%	1.91%	24.75%	1.95%	-4.60%	-0.04%
过去六个月	18.60%	1.76%	24.15%	1.79%	-5.55%	-0.03%
自基金合同生效起至今	18.64%	1.61%	25.36%	1.66%	-6.72%	-0.05%

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



注：本基金合同生效日期为 2025 年 09 月 17 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

§ 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		
张亦驰先生	本基金的基金经理	2025 年 9 月 17 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遵规守信情况的说明

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、《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

情。

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、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 1.1864 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.60%，业绩比较基准收益率为 24.15%。

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金（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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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。

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、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：银华创业板综合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	713,339.90	4,547,556.36
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	99,310,112.15	419,942,410.52
其中：股票投资		99,310,112.15	419,942,410.52
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		100,023,452.05	424,489,966.88
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		-	35,428.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,933.89	80,658.60
应付托管费		4,644.60	26,886.19
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	135,803.33	30,000.00
负债合计		154,381.82	172,972.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	84,174,931.00	424,174,931.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,694,139.23	142,062.91
净资产合计		99,869,070.23	424,316,993.91
负债和净资产总计		100,023,452.05	424,489,966.88

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1864 元，基金份额总额 84,174,931.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华创业板综合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
一、营业总收入		39,227,060.49
1.利息收入		970.15
其中：存款利息收入	6.4.7.13	970.15
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）		41,821,075.00
其中：股票投资收益	6.4.7.14	41,132,064.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	689,010.26
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	-2,594,984.66
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	-
减：二、营业总支出		322,900.34
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	141,378.17
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	47,126.04
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	134,396.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,904,160.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,904,160.15
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		38,904,160.15

注：本基金合同生效日为 2025 年 09 月 17 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：银华创业板综合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	424,174,931.00	-	142,062.91	424,316,993.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	424,174,931.00	-	142,062.91	424,316,993.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-340,000,000.00	-	15,552,076.32	-324,447,923.68
（一）、综合收益总额	-	-	38,904,160.15	38,904,160.15
（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）	-340,000,000.00	-	-23,352,083.83	-363,352,083.83
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-340,000,000.00	-	-23,352,083.83	-363,352,083.83
（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	84,174,931.00	-	15,694,139.23	99,869,070.23

注：本基金合同生效日为 2025 年 09 月 17 日，无上年度可比期间数据。

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

银华创业板综合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〔2025〕1581 号文《关于准予银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 244,163,000.00 元，经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）第 XYZH/2025BJAB2B0552 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 244,174,931.00 份，其中认购资金利息折合 11,931.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证,下同)。本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板股票、创业板股票、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(含分离交易的可转换公司债券)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权、国债期货)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其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。

本基金的投资组合比例为：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、股票期权合约和国债期货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。如果法律法规或中国证监会变更相关投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例或按变更后的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：创业板综合指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以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

依据财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告，将证券投资基金金融商品转让免征增值税优惠主体明确限定为公募证券投资基金，优惠执行期限为 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日；财政部、税务总局、中国证监会公告 2026 年第

8 号关于延续实施创新企业境内发行存托凭证时点阶段有关税收政策的公告，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）管理人运营基金过程中转让创新企业 CDR 取得的差价收入，暂免征收增值税。

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》、财政部、税务总局、中国证监会公告 2026 年第 8 号《关于延续实施创新企业境内发行存托凭证时点阶段有关税收政策的公告》、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《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)根据财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》，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。仅公募证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对转让创新企业 CDR 取得的金融商品转让差价收入免征增值税，对金融同业往来利息收入（其中金融债券部分征收）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，继续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。自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳股票交易印花税。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	309,794.58
等于：本金	309,769.33
加：应计利息	25.25
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	403,545.32
等于：本金	403,538.62
加：应计利息	6.70
减：坏账准备	-
合计	713,339.90

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		87,135,424.94	-	99,310,112.15	12,174,687.21
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		87,135,424.94	-	99,310,112.15	12,174,687.21

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	133,891.13
其他	1,912.20
合计	135,803.33

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	424,174,931.00	424,174,931.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-340,000,000.00	-340,000,000.00
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	84,174,931.00	84,174,931.00

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	8,948,970.20	-8,806,907.29	142,062.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,948,970.20	-8,806,907.29	142,062.91
本期利润	41,499,144.81	-2,594,984.66	38,904,160.15
本期基金份额交易产生的变动数	-28,328,564.91	4,976,481.08	-23,352,083.83
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-28,328,564.91	4,976,481.08	-23,352,083.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,119,550.10	-6,425,410.87	15,694,139.23

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	659.64
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	310.51
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	970.15

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	11,609,001.73
股票投资收益——赎回差价收入	29,523,063.01
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	41,132,064.74

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	80,004,037.13
减：卖出股票成本总额	68,322,606.69
减：交易费用	72,428.71
买卖股票差价收入	11,609,001.73

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	363,352,083.83
减：现金支付赎回款总额	9,754,123.83
减：赎回股票成本总额	324,074,896.99
减：交易费用	-
赎回差价收入	29,523,063.01

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	689,010.26
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	689,010.26

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	-2,594,984.66
股票投资	-2,594,984.66
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	-2,594,984.66

6.4.7.21 其他收入

注：无。

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	105.00
其他	59,907.37
合计	134,396.13

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人

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(“银华创业板综合 ETF 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
当期发生的基金应支付的管理费	141,378.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,923.52
应支付基金管理人的净管理费	130,454.65

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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

当期发生的基金应支付的托管费	47,126.04

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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（%）
银华创业板综合ETF联接	66,626,608.00	79.15	328,780,908.00	77.51

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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	309,794.58	659.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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
300332	天壕能源	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	4.30	2026 年 7 月 9 日	4.64	15,700	88,822.50	67,510.00	-

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	713,339.90	-	-	-	713,339.90
交易性金融资产	-	-	-	99,310,112.15	99,310,112.15
资产总计	713,339.90	-	-	99,310,112.15	100,023,452.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,933.89	13,933.89
应付托管费	-	-	-	4,644.60	4,644.60
其他负债	-	-	-	135,803.33	135,803.33
负债总计	-	-	-	154,381.82	154,381.82
利率敏感度缺口	713,339.90	-	-	99,155,730.33	99,869,070.23
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	4,547,556.36	-	-	-	4,547,556.36
交易性金融资产	-	-	-	419,942,410.52	419,942,410.52
资产总计	4,547,556.36	-	-	419,942,410.52	424,489,966.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	80,658.60	80,658.60
应付托管费	-	-	-	26,886.19	26,886.19
应付清算款	-	-	-	35,428.18	35,428.18
其他负债	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	172,972.97	172,972.97

利率敏感度缺口	4,547,556.36	-	-	419,769,437.55	424,316,993.91

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	99,310,112.15	99.44	419,942,410.52	98.97
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	99,310,112.15	99.44	419,942,410.52	98.97

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%	4,791,923.73	18,869,756.87
	业绩比较基准下降 5%	-4,791,923.73	-18,869,756.87

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公开报价。

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	99,242,602.15	419,942,410.52
第二层次	67,510.00	-
第三层次	-	-
合计	99,310,112.15	419,942,410.52

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。

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

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	99,310,112.15	99.29
	其中：股票	99,310,112.15	99.29
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	713,339.90	0.71
8	其他各项资产	-	-
9	合计	100,023,452.05	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	705,929.00	0.71
B	采矿业	170,056.00	0.17

C	制造业	79,813,025.55	79.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	443,313.00	0.44
E	建筑业	93,502.00	0.09
F	批发和零售业	2,789,411.60	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	344,359.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,680,290.60	8.69
J	金融业	1,774,129.00	1.78
K	房地产业	80,454.00	0.08
L	租赁和商务服务业	394,578.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	2,105,634.40	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	846,686.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	174,438.00	0.17
Q	卫生和社会工作	222,466.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	671,840.00	0.67
S	综合	-	-
	合计	99,310,112.15	99.44

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	20,000	7,860,200.00	7.87
2	300308	中际旭创	5,900	7,493,000.00	7.50
3	300502	新易盛	6,220	3,775,540.00	3.78
4	300408	三环集团	9,400	1,568,860.00	1.57
5	300394	天孚通信	5,080	1,537,614.40	1.54
6	300433	蓝思科技	26,100	1,400,526.00	1.40
7	300476	胜宏科技	3,900	1,351,077.00	1.35

8	300274	阳光电源	7,700	1,224,454.00	1.23
9	300059	东方财富	59,400	1,210,572.00	1.21
10	300014	亿纬锂能	15,200	988,456.00	0.99
11	300475	香农芯创	3,000	900,000.00	0.90
12	300661	圣邦股份	5,400	774,792.00	0.78
13	300857	协创数据	2,160	734,184.00	0.74
14	300760	迈瑞医疗	5,300	719,899.00	0.72
15	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.70
16	300666	江丰电子	1,700	626,620.00	0.63
17	300124	汇川技术	9,400	623,502.00	0.62
18	300866	安克创新	5,300	553,850.00	0.55
19	300975	商络电子	10,100	522,675.00	0.52
20	300373	扬杰科技	3,300	518,859.00	0.52
21	300628	亿联网络	14,700	497,154.00	0.50
22	300620	光库科技	1,300	491,660.00	0.49
23	300033	同花顺	1,920	462,720.00	0.46
24	300442	润泽科技	5,500	456,885.00	0.46
25	300456	赛微电子	10,400	441,688.00	0.44
26	300346	南大光电	4,700	435,455.00	0.44
27	300088	长信科技	37,200	431,520.00	0.43
28	300782	卓胜微	3,900	427,362.00	0.43
29	301536	星宸科技	3,300	424,743.00	0.43
30	300207	欣旺达	21,900	415,881.00	0.42
31	300285	国瓷材料	4,000	412,720.00	0.41
32	301150	中一科技	6,080	383,708.80	0.38
33	300418	昆仑万维	9,100	367,276.00	0.37
34	301611	珂玛科技	2,000	360,140.00	0.36
35	300498	温氏股份	29,200	359,744.00	0.36
36	301358	湖南裕能	4,700	356,589.00	0.36
37	301297	富乐德	5,800	355,192.00	0.36
38	300316	晶盛机电	5,700	344,280.00	0.34
39	300489	光智科技	1,100	343,145.00	0.34
40	300811	铂科新材	3,560	337,808.40	0.34
41	300390	天华新能	3,600	336,636.00	0.34
42	300054	鼎龙股份	3,100	328,507.00	0.33
43	301200	大族数控	900	324,585.00	0.33
44	300420	五洋自控	33,300	315,018.00	0.32
45	300292	吴通控股	58,000	314,360.00	0.31
46	300681	英搏尔	10,600	303,372.00	0.30
47	300761	立华股份	17,700	290,457.00	0.29
48	300493	润欣科技	19,400	289,254.00	0.29
49	300188	国投智能	30,100	281,435.00	0.28
50	300436	广生堂	2,600	279,864.00	0.28

51	300223	君正股份	1,100	273,790.00	0.27
52	300134	大富科技	31,900	272,745.00	0.27
53	301486	致尚科技	1,300	270,816.00	0.27
54	300623	捷捷微电	6,000	269,940.00	0.27
55	301216	万凯新材	11,500	264,385.00	0.26
56	300903	科翔股份	2,600	263,406.00	0.26
57	300638	广和通	14,200	262,842.00	0.26
58	300745	欣锐科技	6,200	261,764.00	0.26
59	300257	开山股份	9,100	260,988.00	0.26
60	300005	探路者	11,400	257,640.00	0.26
61	300763	锦浪科技	2,800	252,980.00	0.25
62	300319	麦捷科技	8,500	251,855.00	0.25
63	300118	东方日升	20,200	251,490.00	0.25
64	301217	铜冠铜箔	1,500	247,605.00	0.25
65	301511	德福科技	1,700	244,545.00	0.24
66	300077	国民技术	7,800	244,530.00	0.24
67	300327	中颖电子	7,600	243,580.00	0.24
68	300657	弘信电子	5,500	242,110.00	0.24
69	300444	双杰电气	19,800	241,758.00	0.24
70	300604	长川科技	700	238,994.00	0.24
71	300775	三角防务	10,500	231,420.00	0.23
72	300699	光威复材	8,000	229,200.00	0.23
73	300263	隆华科技	13,900	226,570.00	0.23
74	300168	万达信息	49,100	225,369.00	0.23
75	300529	健帆生物	14,600	224,840.00	0.23
76	301013	利和兴	3,100	223,975.00	0.22
77	300627	华测导航	7,800	221,520.00	0.22
78	300065	海兰信	9,900	220,869.00	0.22
79	300331	苏大维格	3,100	220,441.00	0.22
80	300222	科大智能	15,800	218,830.00	0.22
81	300221	银禧科技	13,600	218,552.00	0.22
82	300166	东方国信	12,300	217,833.00	0.22
83	300679	电连技术	3,600	215,964.00	0.22
84	301526	国际复材	4,600	214,682.00	0.21
85	300136	信维通信	1,800	214,650.00	0.21
86	300174	元力股份	7,300	213,306.00	0.21
87	301327	华宝新能	4,400	211,508.00	0.21
88	301031	中熔电气	1,720	205,454.00	0.21
89	300842	帝科股份	2,300	205,091.00	0.21
90	300677	英科医疗	5,200	203,684.00	0.20
91	301292	海科新源	2,500	199,325.00	0.20
92	300687	赛意信息	6,400	198,400.00	0.20
93	300435	中泰股份	7,300	197,611.00	0.20

94	300570	太辰光	800	197,368.00	0.20
95	300432	富临精工	9,700	194,873.00	0.20
96	300185	通裕重工	71,300	194,649.00	0.19
97	301275	汉朔科技	4,300	193,070.00	0.19
98	301248	杰创智能	2,300	193,039.00	0.19
99	300607	拓斯达	4,600	189,658.00	0.19
100	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.19
101	300001	特锐德	4,900	185,367.00	0.19
102	300458	全志科技	4,660	183,883.60	0.18
103	300142	沃森生物	14,100	183,159.00	0.18
104	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.18
105	300307	慈星股份	24,400	179,828.00	0.18
106	300133	华策影视	25,300	179,124.00	0.18
107	300469	信息发展	3,400	178,874.00	0.18
108	300251	光线传媒	16,100	178,549.00	0.18
109	301127	武汉天源	8,600	178,192.00	0.18
110	300735	光弘科技	7,800	177,372.00	0.18
111	300672	国科微	600	177,000.00	0.18
112	300300	海峡创新	22,500	175,725.00	0.18
113	300130	新国都	8,300	174,632.00	0.17
114	300015	爱尔眼科	21,100	174,286.00	0.17
115	300034	钢研高纳	10,160	174,142.40	0.17
116	300181	佐力药业	12,300	173,430.00	0.17
117	300776	帝尔激光	800	171,968.00	0.17
118	300236	上海新阳	1,300	170,950.00	0.17
119	300888	稳健医疗	6,100	170,739.00	0.17
120	300131	英唐智控	8,900	169,367.00	0.17
121	300569	天能重工	34,700	167,254.00	0.17
122	301096	百诚医药	2,900	165,851.00	0.17
123	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.17
124	301086	鸿富瀚	780	163,238.40	0.16
125	300558	贝达药业	2,498	162,544.86	0.16
126	300772	运达股份	13,200	162,360.00	0.16
127	300401	花园生物	7,400	161,986.00	0.16
128	300022	吉峰科技	20,800	161,616.00	0.16
129	300322	硕贝德	6,400	161,280.00	0.16
130	300861	美畅股份	6,400	161,216.00	0.16
131	300725	药石科技	4,400	161,040.00	0.16
132	300260	新莱应材	1,600	160,736.00	0.16
133	300119	瑞普生物	11,100	160,173.00	0.16
134	300613	富瀚微	2,000	160,160.00	0.16
135	300870	欧陆通	460	159,017.40	0.16
136	300634	彩讯股份	8,100	158,517.00	0.16

137	301236	软通动力	3,700	157,065.00	0.16
138	300925	法本信息	10,500	155,295.00	0.16
139	300151	昌红科技	6,200	154,690.00	0.15
140	300320	海达股份	16,200	154,548.00	0.15
141	301396	宏景科技	460	152,536.00	0.15
142	300213	佳讯飞鸿	25,100	152,106.00	0.15
143	300825	阿尔特	10,600	151,368.00	0.15
144	300184	力源信息	8,500	149,175.00	0.15
145	300979	华利集团	5,000	148,750.00	0.15
146	300031	宝通科技	5,200	148,564.00	0.15
147	300503	昊志机电	1,600	147,680.00	0.15
148	300766	每日互动	6,900	147,660.00	0.15
149	300457	赢合科技	7,000	147,560.00	0.15
150	300841	康华生物	3,100	147,436.00	0.15
151	301188	力诺药包	2,200	147,180.00	0.15
152	300671	富满微	1,700	146,472.00	0.15
153	300146	汤臣倍健	16,200	146,448.00	0.15
154	301021	英诺激光	1,200	146,280.00	0.15
155	300382	斯莱克	6,300	145,593.00	0.15
156	300115	长盈精密	5,200	145,288.00	0.15
157	300474	景嘉微	2,400	145,152.00	0.15
158	300047	天源迪科	16,300	144,744.00	0.14
159	300910	瑞丰新材	5,160	144,686.40	0.14
160	300759	康龙化成	5,000	144,650.00	0.14
161	300383	光环新网	11,600	144,304.00	0.14
162	300576	容大感光	2,800	143,416.00	0.14
163	300201	海伦哲	6,800	143,276.00	0.14
164	300814	中富电路	700	143,150.00	0.14
165	300339	润和软件	3,700	142,487.00	0.14
166	300357	我武生物	6,100	142,252.00	0.14
167	300571	平治信息	3,100	141,546.00	0.14
168	300009	安科生物	18,000	141,300.00	0.14
169	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.14
170	300342	天银机电	3,000	141,000.00	0.14
171	300440	运达科技	6,600	140,778.00	0.14
172	300102	乾照光电	5,400	140,616.00	0.14
173	300037	新宙邦	1,500	139,275.00	0.14
174	300953	震裕科技	1,040	139,048.00	0.14
175	300783	三只松鼠	8,800	139,040.00	0.14
176	301345	涛涛车业	600	138,600.00	0.14
177	300586	美联新材	8,800	137,632.00	0.14
178	300660	江苏雷利	4,940	137,628.40	0.14
179	300002	神州泰岳	17,600	137,456.00	0.14

180	300762	上海瀚讯	3,000	136,950.00	0.14
181	300905	宝丽迪	2,700	136,620.00	0.14
182	300416	苏试试验	6,700	136,546.00	0.14
183	301160	翔楼新材	2,925	136,451.25	0.14
184	300863	卡倍亿	1,780	136,401.40	0.14
185	300454	深信服	1,400	134,680.00	0.13
186	300144	宋城演艺	23,100	134,211.00	0.13
187	301238	瑞泰新材	5,500	134,200.00	0.13
188	301589	诺瓦星云	900	134,082.00	0.13
189	301205	联特科技	400	133,640.00	0.13
190	300204	舒泰神	5,600	133,168.00	0.13
191	300674	宇信科技	8,800	132,440.00	0.13
192	301183	东田微	500	132,435.00	0.13
193	300267	尔康制药	39,900	131,670.00	0.13
194	300443	金雷股份	6,100	131,638.00	0.13
195	300179	四方达	2,200	130,746.00	0.13
196	300041	回天新材	8,400	130,536.00	0.13
197	300348	长亮科技	14,800	130,240.00	0.13
198	301095	广立微	1,100	129,855.00	0.13
199	300398	飞凯材料	2,100	129,675.00	0.13
200	300748	金力永磁	4,200	129,570.00	0.13
201	301071	力量钻石	1,400	129,500.00	0.13
202	300487	蓝晓科技	2,200	129,470.00	0.13
203	301070	开勒股份	1,460	128,480.00	0.13
204	300873	海晨股份	3,800	128,326.00	0.13
205	300692	中赋科技	16,000	127,840.00	0.13
206	300283	温州宏丰	6,200	127,410.00	0.13
207	300026	红日药业	43,900	127,310.00	0.13
208	300450	先导智能	3,100	126,232.00	0.13
209	300518	新迅达	3,800	125,590.00	0.13
210	300790	宇瞳光学	4,800	125,328.00	0.13
211	301191	菲菱科思	1,100	124,905.00	0.13
212	300049	福瑞医科	3,200	124,416.00	0.12
213	300217	东方电热	29,100	124,257.00	0.12
214	300024	机器人	6,400	123,712.00	0.12
215	300602	飞荣达	2,400	122,880.00	0.12
216	300323	华灿光电	6,000	122,400.00	0.12
217	300007	汉威科技	3,200	122,240.00	0.12
218	300832	新产业	2,900	121,800.00	0.12
219	300210	森远股份	14,300	121,264.00	0.12
220	301165	锐捷网络	1,500	120,675.00	0.12
221	300393	中来股份	16,400	119,556.00	0.12
222	301269	华大九天	1,000	119,420.00	0.12

223	300723	一品红	3,200	119,296.00	0.12
224	300700	岱勒新材	5,600	119,168.00	0.12
225	300349	金卡智能	10,800	118,152.00	0.12
226	300315	掌趣科技	30,200	117,780.00	0.12
227	300496	中科创达	1,900	117,401.00	0.12
228	301228	实朴检测	1,500	117,240.00	0.12
229	300655	晶瑞电材	5,435	116,417.70	0.12
230	300287	飞利信	36,100	115,881.00	0.12
231	300777	中简科技	4,400	115,632.00	0.12
232	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.12
233	300042	朗科科技	1,500	114,255.00	0.11
234	300678	中科信息	5,100	114,240.00	0.11
235	300243	瑞丰高材	5,200	113,048.00	0.11
236	300360	炬华科技	9,600	112,800.00	0.11
237	300192	科德教育	6,900	112,608.00	0.11
237	300199	翰宇药业	5,100	112,608.00	0.11
238	300943	春晖智控	2,500	112,375.00	0.11
239	300170	汉得信息	7,300	111,252.00	0.11
240	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.11
241	300618	寒锐钴业	3,100	110,670.00	0.11
242	301580	爱迪特	1,720	110,647.60	0.11
243	301246	宏源药业	4,100	110,290.00	0.11
244	300128	锦富技术	18,600	110,112.00	0.11
245	300718	长盛轴承	1,800	109,746.00	0.11
246	300738	奥飞数据	5,400	109,188.00	0.11
247	300400	劲拓股份	2,900	109,185.00	0.11
248	301487	盟固利	5,700	109,155.00	0.11
249	300363	博腾股份	6,700	108,808.00	0.11
250	300265	通光线缆	5,200	107,536.00	0.11
251	300850	新强联	4,000	107,200.00	0.11
252	300601	康泰生物	9,400	106,596.00	0.11
253	301035	润丰股份	2,290	106,256.00	0.11
254	301128	强瑞技术	680	106,012.00	0.11
255	300720	海川智能	1,100	105,820.00	0.11
256	301382	蜂助手	2,300	105,800.00	0.11
257	301307	美利信	1,400	105,406.00	0.11
258	300304	云意电气	5,900	105,315.00	0.11
259	300035	中科电气	7,300	105,266.00	0.11
260	302132	中航成飞	1,800	104,976.00	0.11
261	300085	银之杰	3,000	104,910.00	0.11
262	301087	可孚医疗	2,200	104,830.00	0.10
263	300459	汤姆猫	30,800	104,412.00	0.10
264	300553	集智股份	1,700	104,363.00	0.10

265	300016	北陆药业	13,600	104,312.00	0.10
266	300253	卫宁健康	15,400	103,642.00	0.10
267	300196	长海股份	3,500	103,495.00	0.10
268	300482	万孚生物	6,200	102,982.00	0.10
269	300568	星源材质	5,500	102,960.00	0.10
270	300468	四方精创	4,900	102,949.00	0.10
271	300890	翔丰华	3,100	102,827.00	0.10
272	300017	网宿科技	7,900	102,779.00	0.10
273	300429	强力新材	5,800	102,776.00	0.10
273	301413	安培龙	1,450	102,776.00	0.10
274	300520	科大国创	3,800	102,372.00	0.10
275	301039	中集车辆	14,500	102,225.00	0.10
276	300827	上能电气	3,300	101,607.00	0.10
277	300573	兴齐眼药	2,490	101,492.40	0.10
278	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.10
279	300617	安靠智电	1,900	100,681.00	0.10
280	301603	乔锋智能	700	100,660.00	0.10
281	301050	雷电微力	3,000	100,320.00	0.10
282	300075	数字政通	9,800	100,156.00	0.10
283	301368	丰立智能	2,400	99,912.00	0.10
284	300182	捷成股份	21,000	99,750.00	0.10
285	300872	天阳科技	6,300	99,540.00	0.10
286	300083	创世纪	7,300	99,426.00	0.10
287	301285	鸿日达	900	99,297.00	0.10
288	300595	欧普康视	9,300	97,929.00	0.10
289	300999	金龙鱼	4,200	97,692.00	0.10
290	300957	贝泰妮	3,100	97,681.00	0.10
290	301055	张小泉	2,300	97,681.00	0.10
291	301606	绿联科技	1,600	97,632.00	0.10
292	300302	同有科技	1,900	97,223.00	0.10
293	300821	东岳硅材	4,700	96,632.00	0.10
294	300919	中伟新材	2,200	96,250.00	0.10
295	300004	南风股份	9,500	95,950.00	0.10
296	300668	杰恩股份	1,600	95,920.00	0.10
297	300294	博雅生物	6,700	95,408.00	0.10
298	300567	精测电子	300	95,280.00	0.10
299	300413	芒果超媒	6,500	95,095.00	0.10
300	300298	三诺生物	6,800	94,860.00	0.09
301	301078	孩子王	14,000	94,640.00	0.09
302	301029	怡合达	3,500	94,535.00	0.09
303	300629	新劲刚	4,400	94,424.00	0.09
304	300473	德尔股份	3,100	94,240.00	0.09
305	300463	迈克生物	11,400	94,164.00	0.09

306	300203	聚光科技	6,800	94,044.00	0.09
307	300378	鼎捷数智	2,600	93,860.00	0.09
308	300547	川环科技	2,800	93,492.00	0.09
309	300624	万兴科技	1,800	93,366.00	0.09
310	301373	凌玮科技	600	93,300.00	0.09
311	300947	德必集团	7,200	91,800.00	0.09
312	300724	捷佳伟创	1,300	91,780.00	0.09
313	301600	慧翰股份	1,000	91,400.00	0.09
314	300632	光莆股份	3,200	91,360.00	0.09
315	300079	数码视讯	21,700	91,140.00	0.09
316	300855	图南股份	2,900	90,654.00	0.09
317	300098	高新兴	19,700	90,423.00	0.09
318	300018	中元股份	7,300	90,155.00	0.09
319	301155	海力风电	2,100	90,090.00	0.09
320	300881	盛德鑫泰	2,400	89,880.00	0.09
321	300209	行云科技	3,100	89,745.00	0.09
322	300806	斯迪克	800	89,600.00	0.09
323	300019	硅宝科技	4,700	89,582.00	0.09
324	300021	大禹节水	22,400	89,376.00	0.09
325	301196	唯科科技	710	89,048.20	0.09
326	300053	航宇微	5,400	88,830.00	0.09
327	300836	佰奥智能	1,200	88,788.00	0.09
328	300012	华测检测	6,400	88,704.00	0.09
329	300296	利亚德	15,700	87,920.00	0.09
330	300036	超图软件	7,800	87,906.00	0.09
331	300303	聚飞光电	7,900	87,374.00	0.09
332	300593	新雷能	2,900	87,174.00	0.09
333	300384	三联虹普	7,600	86,640.00	0.09
334	301392	汇成真空	300	86,592.00	0.09
335	301629	矽电股份	200	86,080.00	0.09
336	301076	新瀚新材	3,280	85,870.40	0.09
337	300858	科拓生物	5,600	85,064.00	0.09
338	300747	锐科激光	1,600	84,944.00	0.09
339	301219	腾远钴业	1,550	84,940.00	0.09
340	300619	金银河	2,730	84,930.30	0.09
341	301136	招标股份	7,700	84,546.00	0.08
342	300101	振芯科技	5,200	84,084.00	0.08
343	300525	博思软件	11,300	84,072.00	0.08
344	301363	美好医疗	4,580	83,951.40	0.08
345	300067	安诺其	15,400	83,468.00	0.08
346	300733	西菱动力	6,970	83,291.50	0.08
347	300685	艾德生物	4,900	82,516.00	0.08
348	300121	阳谷华泰	6,500	81,900.00	0.08

349	300471	厚普股份	9,500	81,795.00	0.08
350	300073	当升科技	1,700	81,668.00	0.08
351	300867	圣元环保	4,500	81,540.00	0.08
352	300276	三丰智能	11,300	81,021.00	0.08
353	300984	金沃股份	1,500	80,595.00	0.08
354	300917	特发服务	3,300	80,454.00	0.08
355	300013	新宁物流	20,600	80,340.00	0.08
356	300395	菲利华	600	80,238.00	0.08
357	300364	中文在线	3,400	80,206.00	0.08
358	301069	凯盛新材	4,000	80,160.00	0.08
359	300403	汉宇集团	8,500	80,070.00	0.08
360	300490	华自科技	6,000	79,380.00	0.08
361	301468	博盈特焊	1,900	79,249.00	0.08
362	300633	开立医疗	4,300	79,077.00	0.08
363	300765	石药创新	2,900	78,967.00	0.08
364	301312	智立方	680	78,886.80	0.08
365	300596	利安隆	1,500	78,720.00	0.08
366	300756	金马游乐	2,380	78,659.00	0.08
367	300688	创业黑马	2,900	78,590.00	0.08
368	301522	上大股份	3,000	78,510.00	0.08
369	300180	华峰超纤	19,900	78,406.00	0.08
370	300470	中密控股	2,700	78,327.00	0.08
371	300693	盛弘股份	1,600	78,000.00	0.08
372	301376	致欧科技	4,400	77,968.00	0.08
373	300900	广联航空	2,000	77,140.00	0.08
374	300058	蓝色光标	5,600	77,056.00	0.08
375	301301	川宁生物	9,700	77,018.00	0.08
376	300641	正丹股份	5,000	76,900.00	0.08
377	300145	南方泵业	14,100	76,845.00	0.08
378	300773	拉卡拉	4,940	75,582.00	0.08
379	300240	飞力达	15,100	75,349.00	0.08
380	300497	富祥股份	3,400	75,344.00	0.08
381	300798	锦鸡股份	11,400	74,442.00	0.07
382	300376	易事特	14,500	74,240.00	0.07
383	300507	苏奥传感	9,800	73,794.00	0.07
383	300739	明阳电路	2,100	73,794.00	0.07
384	300973	立高食品	3,000	73,710.00	0.07
385	301115	联检科技	2,100	73,626.00	0.07
386	300990	同飞股份	700	73,549.00	0.07
387	300008	天海防务	12,100	73,326.00	0.07
388	300109	新开源	4,560	73,188.00	0.07
389	300171	东富龙	6,600	72,996.00	0.07
390	300003	乐普医疗	6,100	72,285.00	0.07

391	301109	军信股份	5,800	72,268.00	0.07
392	300132	**诺斯贝尔**	12,700	72,136.00	0.07
393	301080	百普赛斯	1,500	72,000.00	0.07
394	300066	三川智慧	12,900	71,982.00	0.07
395	300930	屹通新材	2,500	71,250.00	0.07
396	300505	川金诺	3,100	71,145.00	0.07
397	300467	迅游科技	1,900	70,642.00	0.07
398	300228	富瑞特装	9,500	70,300.00	0.07
399	300153	科泰电源	3,100	70,122.00	0.07
400	300676	华大基因	2,000	70,120.00	0.07
401	300896	爱美客	800	69,760.00	0.07
402	300785	值得买	1,900	69,673.00	0.07
403	300972	万辰集团	400	69,364.00	0.07
404	300648	星云股份	1,600	69,152.00	0.07
405	300767	震安科技	3,100	69,099.00	0.07
406	300129	泰胜风能	8,000	68,400.00	0.07
407	301550	斯菱智驱	748	68,389.64	0.07
408	300480	光力科技	1,600	68,288.00	0.07
409	300740	水羊股份	3,700	68,117.00	0.07
410	300846	首都在线	3,200	67,872.00	0.07
411	301093	华兰股份	500	67,815.00	0.07
412	300229	拓尔思	4,900	67,718.00	0.07
413	300809	华辰装备	2,500	67,625.00	0.07
414	300332	天壕能源	15,700	67,510.00	0.07
415	300684	中石科技	1,100	67,100.00	0.07
416	300455	航天智装	3,100	66,774.00	0.07
417	300100	双林股份	2,400	66,672.00	0.07
418	300769	德方纳米	1,000	66,500.00	0.07
419	300358	楚天科技	8,300	66,400.00	0.07
420	301263	泰恩康	3,240	66,387.60	0.07
421	300140	节能环境	13,300	66,101.00	0.07
422	300816	艾可蓝	900	65,880.00	0.07
423	300324	旋极信息	17,700	65,844.00	0.07
424	300149	睿智医药	6,900	65,826.00	0.07
425	301588	美新科技	1,500	65,640.00	0.07
426	300278	华昌达	16,700	64,796.00	0.06
427	300057	万顺新材	7,400	64,232.00	0.06
428	301027	华蓝集团	3,100	64,139.00	0.06
429	300446	航天智造	3,800	63,954.00	0.06
430	300948	冠中生态	2,400	63,912.00	0.06
431	301510	固高科技	2,000	63,860.00	0.06
432	300415	伊之密	3,200	63,712.00	0.06
433	300635	中达安	5,200	63,284.00	0.06

434	300669	沪宁股份	2,400	63,120.00	0.06
435	300082	奥克股份	7,300	62,999.00	0.06
436	300876	蒙泰高新	4,380	62,765.40	0.06
437	300572	安车检测	2,200	62,414.00	0.06
438	300682	朗新科技	6,300	62,370.00	0.06
439	300918	南山智尚	5,800	62,176.00	0.06
440	300712	永福股份	2,900	62,089.00	0.06
441	300045	华力创通	3,600	62,064.00	0.06
442	300122	智飞生物	5,300	61,957.00	0.06
443	300499	高澜股份	1,600	61,920.00	0.06
444	300486	东杰智能	2,900	61,915.00	0.06
445	300492	华图山鼎	1,800	61,830.00	0.06
446	301232	飞沃科技	400	61,580.00	0.06
447	300421	力星股份	3,300	61,083.00	0.06
448	301175	中科环保	12,200	60,390.00	0.06
449	300261	雅本化学	13,500	60,345.00	0.06
450	300350	华鹏飞	15,200	60,344.00	0.06
451	300592	华凯易佰	3,400	60,180.00	0.06
452	300969	恒帅股份	640	60,006.40	0.06
453	300737	科顺股份	9,100	59,787.00	0.06
454	300938	信测标准	1,180	58,858.40	0.06
455	300680	隆盛科技	2,590	58,844.80	0.06
456	300070	碧水源	18,400	58,696.00	0.06
457	300277	汽轮科技	3,900	58,656.00	0.06
458	301007	德迈仕	1,900	58,140.00	0.06
459	300587	天铁科技	15,100	58,135.00	0.06
460	301265	华新科技	2,100	57,855.00	0.06
461	301018	申菱环境	500	57,805.00	0.06
462	301291	明阳电气	1,600	57,584.00	0.06
463	300792	壹网壹创	2,200	57,068.00	0.06
464	300048	合康新能	12,200	56,974.00	0.06
465	300247	融捷健康	15,400	56,518.00	0.06
466	300580	贝斯特	2,800	56,308.00	0.06
467	300731	科创新源	960	56,025.60	0.06
468	300233	金城医药	4,500	55,800.00	0.06
469	301005	超捷股份	500	55,780.00	0.06
470	300189	神农种业	12,900	55,728.00	0.06
471	301225	恒勃股份	700	55,153.00	0.06
472	300729	乐歌股份	5,700	54,834.00	0.05
473	301171	易点天下	1,610	54,675.60	0.05
474	301305	朗坤科技	1,900	54,188.00	0.05
475	300355	蒙草生态	19,700	54,175.00	0.05
476	300893	松原安全	3,340	54,108.00	0.05

477	300137	先河环保	3,100	54,064.00	0.05
478	301058	中粮科工	6,800	52,904.00	0.05
479	300329	海伦钢琴	4,200	52,500.00	0.05
480	300815	玉禾田	3,200	52,320.00	0.05
481	301338	凯格精机	320	52,124.80	0.05
482	300819	聚杰微纤	700	51,814.00	0.05
483	300255	常山药业	2,200	51,524.00	0.05
484	301000	肇民科技	1,600	51,216.00	0.05
485	300063	天龙集团	5,900	51,212.00	0.05
486	300551	古鳌科技	5,200	51,168.00	0.05
487	300113	顺网科技	2,800	50,988.00	0.05
488	300099	尤洛卡	8,000	50,560.00	0.05
489	300409	道氏技术	2,500	49,825.00	0.05
490	300963	中洲特材	3,700	49,691.00	0.05
491	300258	精锻科技	4,500	49,635.00	0.05
492	301091	深城交	3,200	49,600.00	0.05
493	300072	海新能科	14,400	48,960.00	0.05
494	300749	顶固集创	1,800	48,330.00	0.05
495	300779	惠城环保	960	48,192.00	0.05
496	301293	三博脑科	1,000	48,180.00	0.05
496	301529	福赛科技	500	48,180.00	0.05
497	300839	博汇股份	4,100	48,011.00	0.05
498	300055	万邦达	7,300	46,939.00	0.05
499	300161	华中数控	1,600	46,592.00	0.05
500	300703	创源股份	3,600	45,972.00	0.05
501	301061	匠心家居	1,290	45,240.30	0.05
502	300539	横河精密	2,200	44,814.00	0.04
503	300351	永贵电器	2,700	44,550.00	0.04
504	301101	明月镜片	1,600	43,584.00	0.04
505	300284	苏交科	8,700	43,500.00	0.04
506	300249	依米康	2,800	43,120.00	0.04
507	300986	志特新材	2,500	42,875.00	0.04
508	300135	宝利国际	14,000	42,700.00	0.04
509	300084	海默科技	3,500	42,105.00	0.04
510	300461	田中精机	1,100	40,744.00	0.04
511	300290	ST 荣科	6,000	39,900.00	0.04
512	301500	飞南资源	1,500	39,075.00	0.04
513	300483	首华燃气	2,200	38,676.00	0.04
514	301662	宏工科技	380	38,501.60	0.04
515	300056	中创环保	4,600	33,442.00	0.03
516	300191	潜能恒信	1,200	33,180.00	0.03
517	300139	晓程科技	900	32,895.00	0.03
518	300651	金陵体育	1,800	32,130.00	0.03

519	300536	农尚环境	3,700	31,413.00	0.03
520	300157	新锦动力	7,600	28,044.00	0.03
521	301193	家联科技	1,400	25,956.00	0.03
522	300911	亿田智能	1,100	23,375.00	0.02
523	300164	通源石油	2,900	23,200.00	0.02
524	300658	延江股份	1,500	17,145.00	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	300308	中际旭创	1,513,303.00	0.36
2	300750	宁德时代	1,089,327.00	0.26
3	300475	香农芯创	1,050,616.00	0.25
4	300207	欣旺达	846,510.00	0.20
5	300408	三环集团	809,479.15	0.19
6	300014	亿纬锂能	785,108.00	0.19
7	300442	润泽科技	647,424.00	0.15
8	300857	协创数据	618,772.00	0.15
9	300394	天孚通信	618,315.00	0.15
10	300866	安克创新	608,749.00	0.14
11	300672	国科微	593,607.00	0.14
12	300666	江丰电子	593,471.00	0.14
13	301200	大族数控	582,234.00	0.14
14	300274	阳光电源	581,942.00	0.14
15	300782	卓胜微	568,873.00	0.13
16	300456	赛微电子	567,754.00	0.13
17	301486	致尚科技	561,209.00	0.13
18	300811	铂科新材	547,823.00	0.13
19	300316	晶盛机电	507,375.00	0.12
20	300418	昆仑万维	495,890.00	0.12

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	301308	江波龙	2,051,888.00	0.48
2	301377	鼎泰高科	1,593,381.00	0.38
3	300033	同花顺	1,451,885.00	0.34
4	300604	长川科技	1,369,855.00	0.32
5	300570	太辰光	1,121,969.00	0.26

6	300548	长芯博创	1,071,530.00	0.25
7	300124	汇川技术	1,042,511.00	0.25
8	300672	国科微	947,813.00	0.22
9	300102	乾照光电	936,850.00	0.22
10	300087	ST 荃银	895,322.00	0.21
11	301093	华兰股份	867,457.00	0.20
12	300164	通源石油	836,111.00	0.20
13	301200	大族数控	826,404.40	0.19
14	301626	苏州天脉	825,927.00	0.19
15	301392	汇成真空	803,129.00	0.19
16	301205	联特科技	761,337.00	0.18
17	301005	超捷股份	750,272.00	0.18
18	301183	东田微	727,262.00	0.17
19	300803	指南针	727,186.00	0.17
20	300059	东方财富	714,166.00	0.17

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	74,360,189.97
卖出股票收入（成交）总额	80,004,037.13

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

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

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

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（%）
454	185,407.34	69,957,932.00	83.11	14,216,999.00	16.89

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（%）
中国银行股份有限公司－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	66,626,608.00	79.15

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（2025 年 9 月 17 日）基金份额总额	244,174,931.00
本报告期期初基金份额总额	424,174,931.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	340,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,174,931.00

§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

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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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(%)	
国投证券	5	154,364,227.10	100.00	22,519.63	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(%)
国投证券	-	-	-	-	-	-

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,证券时报,中国证券报	2026 年 1 月 5 日
2	《银华创业板综合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
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	《银华创业板综合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
5	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 3 月 28 日
6	《银华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
7	《银华创业板综合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
8	《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
9	《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,三大证券报	2026 年 5 月 11 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	20260101-20260630	328,780,908.00	1,000.00	262,155,300.00	66,626,608.00	79.15
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括： 1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权； 2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会； 3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额； 4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动； 5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华创业板综合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《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4《银华创业板综合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