银华中证800增强策略交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作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 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 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 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 34

7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 46

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 46
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 46
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 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47
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 47
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 48
10.1 基金份额持有人大会决议 48
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 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 48
10.8 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 53
§12 备查文件目录 54
12.1 备查文件目录 54
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	银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	800 增强 ETF
场内简称	中证 800 增强 ETF 银华
基金主代码	159517
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 23 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,742,624.00 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	2023 年 9 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，主要包括（1）指数化投资策略：本基金指数化投资以标的指数的成份股组成及其权重为基础，确定本基金投资组合的基本构成和大致权重，并通过控制投资组合中个股权重对标的指数成份股权重的偏离，实现对标的指数的跟踪和对跟踪误差的控制。（2）量化增强投资策略：本基金将在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并在全市场优先选择综合评估价值较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整，以争取实现指数增强的目标。 建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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 800 指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，采用指数增强投资策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	银华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	杨文辉	张姗
	联系电话	(010)58163000	400-61-95555
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	400-61-95555
传真		(010)58163027	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100738	518040
法定代表人		王珠林	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,454,672.58
本期利润	1,367,042.02
加权平均基金份额本期利润	0.1413
本期加权平均净值利润率	10.25%
本期基金份额净值增长率	14.40%
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	4,153,999.49
期末可供分配基金份额利润	0.4751
期末基金资产净值	12,896,623.49
期末基金份额净值	1.4751
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	47.51%

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、

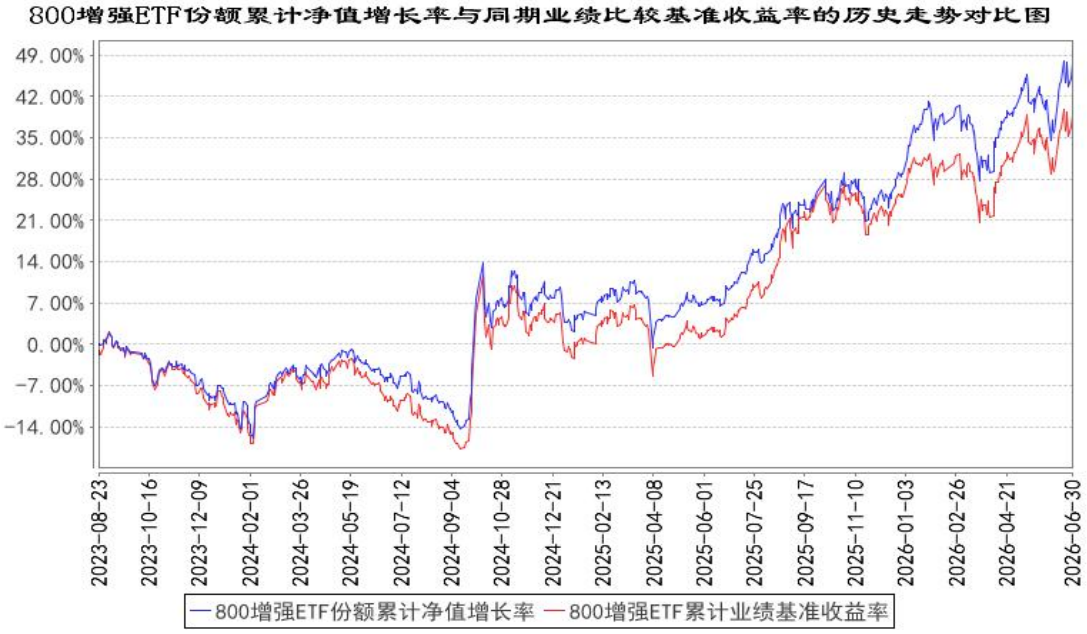
申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	13.78%	1.33%	13.71%	1.34%	0.07%	-0.01%
过去六个月	14.40%	1.26%	11.12%	1.24%	3.28%	0.02%
过去一年	34.47%	1.07%	33.18%	1.10%	1.29%	-0.03%
自基金合同生效起至今	47.51%	1.11%	38.88%	1.19%	8.63%	-0.08%

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		
张凯先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 日	-	16.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监/中心负责人/投资经理助理（社保、基本养老）/基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 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 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 17 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 2020 年 11 月 26 日至 2022 年 7 月 28 日兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2020 年 11

					月 30 日起兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 2 月 23 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 5 月 13 日至 2022 年 6 月 17 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 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 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 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 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 2021 年 9 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 19 日至 2025 年 4 月 28 日兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日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 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 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 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日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 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 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 8 月 23 日起兼任银华中证 800 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 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 2025 年 8 月 20 日起兼任银华上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 9 月 16 日起兼任银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2026 年 3 月 18 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张卓希	本基金的	2025 年	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事

女士	基金经理助理	10 月 22 日			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、《银华中证 800 增强策略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 1.4751 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.40%，业绩比较基准收益率为 11.12%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 6.5%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 4 月 19 日至 2026 年 6 月 30 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。自 2024 年 7 月 18 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 增强策略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	313,828.22	505,683.99
结算备付金		105,119.73	24,114.10
存出保证金		4,317.24	1,537.06
交易性金融资产	6.4.7.2	12,464,902.83	10,712,924.24
其中：股票投资		12,464,902.83	10,712,924.24
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		32,395.66	81,840.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	1,245.00	1,710.00
资产总计		12,921,808.68	11,327,809.91
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		10,691.27	45,761.69
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,087.03	4,672.96
应付托管费		1,017.41	934.57
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	8,389.48	3,632.49
负债合计		25,185.19	55,001.71
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	8,742,624.00	8,742,624.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,153,999.49	2,530,184.20
净资产合计		12,896,623.49	11,272,808.20
负债和净资产总计		12,921,808.68	11,327,809.91

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4751 元，基金份额总额 8,742,624.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,406,584.71	291,997.58
1.利息收入		1,114.09	1,157.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,114.09	1,157.21
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）		1,418,574.01	201,449.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,329,417.75	7,198.82
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	89,156.26	194,251.01
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	-87,630.56	89,390.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	74,527.17	-

减：二、营业总支出		39,542.69	46,813.60
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	32,950.49	39,010.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	6,590.04	7,802.11
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	2.16	0.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,367,042.02	245,183.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,367,042.02	245,183.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,367,042.02	245,183.98

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 800 增强策略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	8,742,624.00	-	2,530,184.20	11,272,808.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	8,742,624.00	-	2,530,184.20	11,272,808.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	1,623,815.29	1,623,815.29
（一）、综合收益总额	-	-	1,367,042.02	1,367,042.02

（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）	-	-	256,773.27	256,773.27
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	-	4,706,715.69	16,706,715.69
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-	-4,449,942.42	-16,449,942.42
（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	8,742,624.00	-	4,153,999.49	12,896,623.49

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	14,742,624.00	-	1,185,503.35	15,928,127.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,742,624.00	-	1,185,503.35	15,928,127.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	245,183.98	245,183.98
（一）、综合收益总额	-	-	245,183.98	245,183.98
（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）				
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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	14,742,624.00	-	1,430,687.33	16,173,311.33

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 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1419 号《关于准予银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 245,731,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0421 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 245,742,624.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,624.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]810 号核准，本基金 245,742,624.00

份基金份额于 2023 年 9 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金可以根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	313,828.22
等于：本金	313,794.08
加：应计利息	34.14
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	313,828.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,022,859.05	-	12,464,902.83	442,043.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	12,022,859.05	-	12,464,902.83	442,043.78

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,245.00
待摊费用	-
合计	1,245.00

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,389.48
其中：交易所市场	8,389.48
银行间市场	-
应付利息	-
合计	8,389.48

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	8,742,624.00	8,742,624.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
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	8,742,624.00	8,742,624.00

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	2,644,145.38	-113,961.18	2,530,184.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,644,145.38	-113,961.18	2,530,184.20
本期利润	1,454,672.58	-87,630.56	1,367,042.02
本期基金份额交易产生的变动数	94,887.10	161,886.17	256,773.27
其中：基金申购款	4,854,657.23	-147,941.54	4,706,715.69
基金赎回款	-4,759,770.13	309,827.71	-4,449,942.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,193,705.06	-39,705.57	4,153,999.49

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	989.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	119.70
其他	4.65
合计	1,114.09

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	1,142,174.40
股票投资收益——赎回差价收入	187,243.35
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	1,329,417.75

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	53,435,000.00
减：卖出股票成本总额	52,243,606.05
减：交易费用	49,219.55

买卖股票差价收入	1,142,174.40

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	16,449,942.42
减：现金支付赎回款总额	9,988,004.42
减：赎回股票成本总额	6,274,694.65
减：交易费用	-
赎回差价收入	187,243.35

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	89,156.26
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	89,156.26

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	-87,630.56
股票投资	-87,630.56
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	-87,630.56

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	74,527.17
合计	74,527.17

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	2.16
合计	2.16

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,950.49	39,010.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,501.07	3,886.65
应支付基金管理人的净管理费	27,449.42	35,124.31

注：本基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理费＝前一日基金资产净值 × 0.50%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,590.04	7,802.11

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	313,828.22	989.74	691,803.86	1,076.70

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

自 2024 年 7 月 18 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	313,828.22	-	-	-	313,828.22
结算备付金	105,119.73	-	-	-	105,119.73

存出保证金	4,317.24	-	-	-	4,317.24
交易性金融资产	-	-	-	12,464,902.83	12,464,902.83
应收清算款	-	-	-	32,395.66	32,395.66
其他资产	-	-	-	1,245.00	1,245.00
资产总计	423,265.19	-	-	12,498,543.49	12,921,808.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,087.03	5,087.03
应付托管费	-	-	-	1,017.41	1,017.41
应付清算款	-	-	-	10,691.27	10,691.27
其他负债	-	-	-	8,389.48	8,389.48
负债总计	-	-	-	25,185.19	25,185.19
利率敏感度缺口	423,265.19	-	-	12,473,358.30	12,896,623.49
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	505,683.99	-	-	-	505,683.99
结算备付金	24,114.10	-	-	-	24,114.10
存出保证金	1,537.06	-	-	-	1,537.06
交易性金融资产	-	-	-	10,712,924.24	10,712,924.24
应收清算款	-	-	-	81,840.52	81,840.52
其他资产	-	-	-	1,710.00	1,710.00
资产总计	531,335.15	-	-	10,796,474.76	11,327,809.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,672.96	4,672.96
应付托管费	-	-	-	934.57	934.57
应付清算款	-	-	-	45,761.69	45,761.69
其他负债	-	-	-	3,632.49	3,632.49
负债总计	-	-	-	55,001.71	55,001.71
利率敏感度缺口	531,335.15	-	-	10,741,473.05	11,272,808.20

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	12,464,902.83	96.65	10,712,924.24	95.03
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,464,902.83	96.65	10,712,924.24	95.03

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%	621,329.86	510,996.25
	业绩比较基准下降5%	-621,329.86	-510,996.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	12,464,902.83	10,712,924.24
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	12,464,902.83	10,712,924.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,464,902.83	96.46
	其中：股票	12,464,902.83	96.46
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	418,947.95	3.24
8	其他各项资产	37,957.90	0.29
9	合计	12,921,808.68	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	458,490.00	3.56
C	制造业	7,926,038.30	61.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	342,205.00	2.65
E	建筑业	36,917.00	0.29
F	批发和零售业	11,100.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	242,445.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	482,040.30	3.74
J	金融业	1,775,879.00	13.77

K	房地产业	22,354.00	0.17
L	租赁和商务服务业	132,426.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	140,989.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	27,922.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,084.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,612,889.60	90.05

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	61,102.00	0.47
C	制造业	628,264.73	4.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,426.00	0.16
F	批发和零售业	24,310.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,098.50	0.78
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	8,152.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	9,660.00	0.07
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	852,013.23	6.61

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	380	482,600.00	3.74
2	300502	新易盛	460	279,220.00	2.17
3	300750	宁德时代	500	196,505.00	1.52
4	002384	东山精密	600	157,410.00	1.22
5	601166	兴业银行	8,600	142,416.00	1.10
6	600030	中信证券	4,700	135,031.00	1.05
7	000333	美的集团	1,600	120,848.00	0.94
8	002371	北方华创	135	119,415.60	0.93
9	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.92
10	600900	长江电力	4,400	116,468.00	0.90
11	603259	药明康德	900	112,059.00	0.87
12	688041	海光信息	278	102,943.40	0.80
13	300857	协创数据	300	101,970.00	0.79
14	002475	立讯精密	1,400	98,560.00	0.76
15	600919	江苏银行	9,000	97,020.00	0.75
16	600150	中国船舶	2,800	94,612.00	0.73
17	688012	中微公司	200	93,700.00	0.73
18	000959	首钢股份	25,600	89,856.00	0.70
19	600000	浦发银行	9,700	83,517.00	0.65
20	300408	三环集团	500	83,450.00	0.65
21	601288	农业银行	13,600	82,552.00	0.64
22	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.63
23	688981	中芯国际	506	80,362.92	0.62
24	601211	国泰海通	4,400	80,080.00	0.62
25	000651	格力电器	2,100	78,750.00	0.61
26	600309	万华化学	1,150	78,671.50	0.61
27	000792	盐湖股份	2,600	78,494.00	0.61
28	000001	平安银行	7,700	77,385.00	0.60
29	000725	京东方 A	8,800	76,384.00	0.59
30	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.59
31	601988	中国银行	13,000	74,360.00	0.58
32	601688	华泰证券	3,500	72,170.00	0.56
33	601872	招商轮船	4,100	72,037.00	0.56
34	002460	赣锋锂业	1,100	71,940.00	0.56

35	300661	圣邦股份	500	71,740.00	0.56
36	601939	建设银行	7,400	71,262.00	0.55
37	002600	领益智造	4,100	71,094.00	0.55
38	000338	潍柴动力	2,600	70,850.00	0.55
39	301308	江波龙	100	70,380.00	0.55
40	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.54
41	300274	阳光电源	440	69,968.80	0.54
42	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.54
43	300418	昆仑万维	1,700	68,612.00	0.53
44	688396	华润微	694	67,699.70	0.52
45	300442	润泽科技	800	66,456.00	0.52
46	688120	华海清科	206	66,369.08	0.51
47	300124	汇川技术	1,000	66,330.00	0.51
48	600809	山西汾酒	600	65,622.00	0.51
49	002142	宁波银行	2,200	65,318.00	0.51
50	002415	海康威视	1,900	64,980.00	0.50
51	601728	中国电信	12,400	64,356.00	0.50
52	000630	铜陵有色	10,000	63,600.00	0.49
53	000301	东方盛虹	5,500	62,975.00	0.49
54	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.49
55	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.48
56	300059	东方财富	3,000	61,140.00	0.47
57	002463	沪电股份	400	61,120.00	0.47
58	300394	天孚通信	200	60,536.00	0.47
59	600346	恒力石化	3,400	60,214.00	0.47
60	601336	新华保险	1,000	59,660.00	0.46
61	688301	奕瑞科技	480	59,520.00	0.46
62	600031	三一重工	3,400	58,752.00	0.46
63	600011	华能国际	7,600	57,684.00	0.45
64	600875	东方电气	2,000	57,540.00	0.45
65	300001	特锐德	1,500	56,745.00	0.44
66	600362	江西铜业	1,300	56,290.00	0.44
67	301611	珂玛科技	300	54,021.00	0.42
68	300450	先导智能	1,300	52,936.00	0.41
69	601699	潞安环能	3,700	52,836.00	0.41
70	600016	民生银行	16,400	52,808.00	0.41
71	601899	紫金矿业	2,100	52,794.00	0.41
72	302132	中航成飞	900	52,488.00	0.41
73	002493	荣盛石化	4,800	51,600.00	0.40
74	600176	中国巨石	700	51,016.00	0.40
75	600999	招商证券	2,400	50,640.00	0.39
76	601628	中国人寿	1,400	49,490.00	0.38
77	300570	太辰光	200	49,342.00	0.38

78	603993	洛阳钼业	2,800	49,140.00	0.38
79	002466	天齐锂业	800	49,056.00	0.38
80	002195	岩山科技	7,500	49,050.00	0.38
81	688336	三生国健	923	49,011.30	0.38
82	000408	藏格矿业	700	48,524.00	0.38
83	001389	广合科技	200	47,450.00	0.37
84	000967	盈峰环境	4,500	47,385.00	0.37
85	600547	山东黄金	2,000	46,180.00	0.36
86	600893	航发动力	1,200	46,008.00	0.36
87	002916	深南电路	100	45,790.00	0.36
88	300142	沃森生物	3,500	45,465.00	0.35
89	000021	深科技	700	44,989.00	0.35
90	600989	宝丰能源	2,200	44,726.00	0.35
91	688002	睿创微纳	285	44,086.65	0.34
92	601995	中金公司	1,200	43,380.00	0.34
93	600026	中远海能	2,400	43,056.00	0.33
94	603019	中科曙光	400	42,892.00	0.33
95	600160	巨化股份	800	42,408.00	0.33
96	301526	国际复材	900	42,003.00	0.33
97	000983	山西焦煤	7,200	41,760.00	0.32
98	600115	中国东航	10,900	41,529.00	0.32
99	600879	航天电子	1,900	40,451.00	0.31
100	301165	锐捷网络	500	40,225.00	0.31
101	601601	中国太保	1,400	39,928.00	0.31
102	002594	比亚迪	500	39,850.00	0.31
103	000063	中兴通讯	1,100	39,809.00	0.31
104	002050	三花智控	900	39,447.00	0.31
105	300014	亿纬锂能	600	39,018.00	0.30
106	301536	星宸科技	300	38,613.00	0.30
107	601212	白银有色	7,600	38,608.00	0.30
108	300058	蓝色光标	2,800	38,528.00	0.30
109	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.30
110	300433	蓝思科技	700	37,562.00	0.29
111	300390	天华新能	400	37,404.00	0.29
112	601225	陕西煤业	1,800	36,630.00	0.28
113	301200	大族数控	100	36,065.00	0.28
114	002709	天赐材料	700	36,001.00	0.28
115	000415	渤海租赁	8,800	35,816.00	0.28
116	002131	利欧股份	7,500	35,625.00	0.28
117	002049	紫光国微	400	35,500.00	0.28
118	601985	中国核电	3,900	35,217.00	0.27
119	688220	翱捷科技	280	34,809.60	0.27
120	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.27

121	600183	生益科技	200	34,680.00	0.27
122	002304	洋河股份	900	34,335.00	0.27
123	603799	华友钴业	700	33,782.00	0.26
124	600460	士兰微	600	32,796.00	0.25
125	688183	生益电子	247	32,702.80	0.25
126	688303	大全能源	1,876	32,698.68	0.25
127	603296	华勤技术	440	32,678.80	0.25
128	601009	南京银行	3,300	32,637.00	0.25
129	600299	安迪苏	4,100	32,185.00	0.25
130	300866	安克创新	300	31,350.00	0.24
131	600276	恒瑞医药	600	31,224.00	0.24
132	601818	光大银行	10,800	31,212.00	0.24
133	000568	泸州老窖	400	31,008.00	0.24
134	601127	赛力斯	500	30,625.00	0.24
135	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.24
136	600486	扬农化工	600	30,420.00	0.24
137	000858	五 粮 液	400	29,600.00	0.23
138	688126	沪硅产业	742	29,598.38	0.23
139	002738	中矿资源	500	29,495.00	0.23
140	300759	康龙化成	1,000	28,930.00	0.22
141	000625	长安汽车	4,000	28,680.00	0.22
142	601318	中国平安	600	28,644.00	0.22
143	601689	拓普集团	500	28,210.00	0.22
144	600886	国投电力	2,100	27,951.00	0.22
145	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.22
146	600438	通威股份	2,300	27,853.00	0.22
147	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.22
148	000831	中国稀土	500	27,745.00	0.22
149	601877	正泰电器	1,100	27,577.00	0.21
150	300803	指南针	300	27,501.00	0.21
151	688187	时代电气	400	27,464.00	0.21
152	688111	金山办公	128	27,270.40	0.21
153	000060	中金岭南	3,600	27,252.00	0.21
154	000703	恒逸石化	2,000	27,140.00	0.21
155	000783	长江证券	2,700	26,325.00	0.20
156	600988	赤峰黄金	1,000	26,320.00	0.20
157	600601	方正科技	1,900	26,296.00	0.20
158	601111	中国国航	4,300	26,015.00	0.20
159	600029	南方航空	5,000	25,900.00	0.20
160	600588	用友网络	2,800	25,704.00	0.20
161	002472	双环传动	600	24,906.00	0.19
162	300223	君正股份	100	24,890.00	0.19
163	601398	工商银行	3,500	24,745.00	0.19

164	600522	中天科技	400	24,272.00	0.19
165	002625	光启技术	800	24,256.00	0.19
166	300316	晶盛机电	400	24,160.00	0.19
166	603308	应流股份	400	24,160.00	0.19
167	300033	同花顺	100	24,100.00	0.19
168	600111	北方稀土	500	24,025.00	0.19
169	600887	伊利股份	1,000	23,960.00	0.19
170	300136	信维通信	200	23,850.00	0.18
171	688777	中控技术	200	23,500.00	0.18
172	601611	中国核建	2,100	23,415.00	0.18
173	300339	润和软件	600	23,106.00	0.18
174	688387	信科移动	1,156	22,935.04	0.18
175	300140	节能环境	4,600	22,862.00	0.18
176	300207	欣旺达	1,200	22,788.00	0.18
177	603885	吉祥航空	2,200	22,638.00	0.18
178	601958	金钼股份	800	22,488.00	0.17
179	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.17
180	601696	中银证券	1,700	21,505.00	0.17
181	002414	高德红外	1,600	21,216.00	0.16
182	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.16
183	688599	天合光能	1,489	21,024.68	0.16
184	600028	中国石化	4,700	20,962.00	0.16
185	000100	TCL 科技	3,600	20,952.00	0.16
186	600126	杭钢股份	3,400	20,842.00	0.16
187	600584	长电科技	200	20,710.00	0.16
188	688099	晶晨股份	201	20,682.90	0.16
189	688538	和辉光电	7,833	20,365.80	0.16
190	600685	中船防务	800	20,352.00	0.16
191	600089	特变电工	900	20,250.00	0.16
192	600166	福田汽车	6,900	20,079.00	0.16
193	603077	和邦生物	8,500	19,720.00	0.15
194	603156	养元饮品	400	19,628.00	0.15
195	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.15
196	600578	京能电力	3,000	19,350.00	0.15
197	300454	深信服	200	19,240.00	0.15
198	002850	科达利	100	18,930.00	0.15
199	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.15
200	600095	湘财股份	2,500	18,825.00	0.15
201	300346	南大光电	200	18,530.00	0.14
202	601012	隆基绿能	1,400	18,368.00	0.14
203	600808	马钢股份	7,200	18,000.00	0.14
204	000425	徐工机械	2,200	17,798.00	0.14
205	600926	杭州银行	1,200	17,340.00	0.13

206	002028	思源电气	100	17,300.00	0.13
207	600549	厦门钨业	200	17,040.00	0.13
208	601658	邮储银行	3,400	16,762.00	0.13
209	600021	上海电力	1,100	16,577.00	0.13
210	002230	科大讯飞	400	16,336.00	0.13
211	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.13
212	601888	中国中免	300	16,113.00	0.12
213	300017	网宿科技	1,200	15,612.00	0.12
214	600010	包钢股份	7,000	15,610.00	0.12
215	002422	科伦药业	400	15,408.00	0.12
216	301358	湖南裕能	200	15,174.00	0.12
217	603806	福斯特	900	15,111.00	0.12
218	002138	顺络电子	200	14,620.00	0.11
219	601066	中信建投	500	14,535.00	0.11
220	002202	金风科技	600	14,340.00	0.11
221	600690	海尔智家	700	14,287.00	0.11
222	600188	兖矿能源	800	14,216.00	0.11
223	001979	招商蛇口	2,200	14,146.00	0.11
224	002432	九安医疗	200	14,136.00	0.11
225	002044	美年健康	2,800	14,084.00	0.11
226	601360	三六零	1,600	13,904.00	0.11
227	002074	国轩高科	500	13,755.00	0.11
228	688036	传音控股	232	13,676.40	0.11
229	002812	恩捷股份	200	13,382.00	0.10
230	300395	菲利华	100	13,373.00	0.10
231	688728	格科微	635	13,360.40	0.10
232	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.10
233	600699	均胜电子	600	12,966.00	0.10
234	301236	软通动力	300	12,735.00	0.10
235	000617	中油资本	1,900	12,521.00	0.10
236	600027	华电国际	2,800	12,460.00	0.10
237	600918	中泰证券	2,300	12,236.00	0.09
238	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.09
239	601898	中煤能源	1,000	12,180.00	0.09
240	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.09
241	601698	中国卫通	400	12,100.00	0.09
242	600711	盛屯矿业	1,100	12,067.00	0.09
243	603179	新泉股份	240	11,916.00	0.09
244	601808	中海油服	1,100	11,891.00	0.09
245	300458	全志科技	300	11,838.00	0.09
246	603979	金诚信	200	11,806.00	0.09
247	300487	蓝晓科技	200	11,770.00	0.09
248	002683	广东宏大	400	11,716.00	0.09

249	600863	华能蒙电	2,400	11,280.00	0.09
250	601298	青岛港	1,400	11,270.00	0.09
251	600060	海信视像	400	11,148.00	0.09
252	000034	神州数码	400	11,100.00	0.09
253	600499	科达制造	800	11,040.00	0.09
254	601328	交通银行	1,700	10,931.00	0.08
255	000921	海信家电	400	10,928.00	0.08
255	600436	片仔癀	100	10,928.00	0.08
256	600497	驰宏锌锗	900	10,899.00	0.08
257	600884	杉杉股份	800	10,840.00	0.08
258	600489	中金黄金	600	10,830.00	0.08
259	688180	君实生物	311	10,518.02	0.08
260	601615	明阳智能	900	10,413.00	0.08
261	000559	万向钱潮	800	10,344.00	0.08
262	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.08
263	603699	纽威股份	200	10,060.00	0.08
264	600909	华安证券	900	9,999.00	0.08
265	000050	深天马 A	1,000	9,910.00	0.08
266	002601	龙佰集团	600	9,888.00	0.08
267	600546	山煤国际	900	9,837.00	0.08
268	601399	国机重装	2,800	9,800.00	0.08
269	600967	内蒙一机	900	9,765.00	0.08
270	000039	中集集团	1,200	9,732.00	0.08
271	601016	节能风电	2,500	9,700.00	0.08
272	600602	云赛智联	600	9,648.00	0.07
273	688166	博瑞医药	275	9,627.75	0.07
274	603920	世运电路	200	9,608.00	0.07
275	000539	粤电力 A	1,400	9,534.00	0.07
276	600816	建元信托	3,900	9,516.00	0.07
277	000027	深圳能源	1,500	9,300.00	0.07
278	002179	中航光电	200	9,240.00	0.07
279	002056	横店东磁	300	9,144.00	0.07
280	300735	光弘科技	400	9,096.00	0.07
281	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.07
282	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.07
283	300623	捷捷微电	200	8,998.00	0.07
284	002608	江苏国信	1,300	8,970.00	0.07
285	601567	三星电气	600	8,964.00	0.07
286	600906	财达证券	1,200	8,952.00	0.07
287	002670	国盛证券	800	8,800.00	0.07
288	600131	国网信通	600	8,760.00	0.07
289	601155	新城控股	800	8,208.00	0.06
290	601857	中国石油	900	7,812.00	0.06

291	002025	航天电器	100	7,622.00	0.06
292	603737	三棵树	300	7,230.00	0.06
293	600985	淮北矿业	500	7,025.00	0.05
294	002252	上海莱士	1,600	6,944.00	0.05
295	600153	建发股份	800	6,344.00	0.05
296	600995	南网储能	500	6,150.00	0.05
297	300718	长盛轴承	100	6,097.00	0.05
298	603392	万泰生物	200	5,394.00	0.04
299	000728	国元证券	700	5,243.00	0.04
300	601665	齐鲁银行	900	5,193.00	0.04
301	002465	海格通信	400	5,108.00	0.04
302	002266	浙富控股	1,000	5,060.00	0.04
303	000032	深桑达 A	200	4,990.00	0.04
304	002624	完美世界	400	4,968.00	0.04
305	601668	中国建筑	1,100	4,774.00	0.04
306	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.03
307	601868	中国能建	1,400	3,738.00	0.03
308	000830	鲁西化工	300	3,600.00	0.03
309	603288	海天味业	100	3,316.00	0.03
310	002444	巨星科技	100	3,110.00	0.02
311	003816	中国广核	400	1,564.00	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	002484	江海股份	700	73,500.00	0.57
2	688409	富创精密	200	61,250.00	0.47
3	688390	固德威	400	43,404.00	0.34
4	688141	杰华特	279	42,826.50	0.33
5	688652	京仪装备	200	40,034.00	0.31
6	300870	欧陆通	100	34,569.00	0.27
7	301217	铜冠铜箔	200	33,014.00	0.26
8	600338	西藏珠峰	2,100	32,004.00	0.25
9	301000	肇民科技	900	28,809.00	0.22
10	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.21
11	002929	润建股份	400	26,752.00	0.21
12	301381	赛维时代	1,300	23,972.00	0.19
13	688353	华盛锂电	200	23,214.00	0.18
14	300723	一品红	600	22,368.00	0.17
15	002158	汉钟精机	600	22,248.00	0.17
16	688006	杭可科技	596	21,783.80	0.17
17	300687	赛意信息	700	21,700.00	0.17
18	603063	禾望电气	400	21,156.00	0.16
19	600667	太极实业	700	20,426.00	0.16

20	600259	中稀有色	200	20,322.00	0.16
21	301510	固高科技	600	19,158.00	0.15
22	601126	四方股份	300	18,960.00	0.15
23	601003	柳钢股份	5,500	18,535.00	0.14
24	688559	海目星	200	16,784.00	0.13
25	603267	鸿远电子	200	15,496.00	0.12
26	301511	德福科技	100	14,385.00	0.11
27	300602	飞荣达	200	10,240.00	0.08
28	000035	中国天楹	2,000	9,660.00	0.07
29	000672	上峰材料	400	9,472.00	0.07
30	603026	石大胜华	100	8,937.00	0.07
31	002897	意华股份	100	8,798.00	0.07
32	000059	华锦股份	2,300	8,625.00	0.07
33	300416	苏试试验	400	8,152.00	0.06
34	600389	江山股份	400	7,808.00	0.06
35	688779	五矿新能	783	6,350.13	0.05
36	001339	智微智能	60	6,136.80	0.05
37	300684	中石科技	100	6,100.00	0.05
38	300738	奥飞数据	300	6,066.00	0.05
39	600123	兰花科创	1,000	5,340.00	0.04
40	601918	新集能源	400	3,436.00	0.03
41	300098	高新兴	600	2,754.00	0.02
42	002251	步步高	100	338.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	573,548.00	5.09
2	600519	贵州茅台	557,111.00	4.94
3	601899	紫金矿业	519,436.00	4.61
4	300502	新易盛	410,489.00	3.64
5	300750	宁德时代	389,721.00	3.46
6	603986	兆易创新	363,493.00	3.22
7	600900	长江电力	359,456.00	3.19
8	688981	中芯国际	352,879.50	3.13
9	603259	药明康德	328,937.56	2.92
10	688041	海光信息	320,908.00	2.85
11	601318	中国平安	319,637.00	2.84
12	601166	兴业银行	317,954.00	2.82
13	002371	北方华创	313,858.00	2.78
14	601211	国泰海通	305,765.00	2.71
15	601288	农业银行	303,591.00	2.69
16	600030	中信证券	296,010.00	2.63

17	603993	洛阳钼业	281,058.00	2.49
18	688008	澜起科技	278,706.00	2.47
19	688012	中微公司	275,791.48	2.45
20	600919	江苏银行	263,697.00	2.34
21	688347	华虹宏力	245,290.00	2.18
22	601398	工商银行	239,762.00	2.13
23	688256	寒武纪	234,170.00	2.08

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	555,088.00	4.92
2	601899	紫金矿业	538,318.00	4.78
3	300308	中际旭创	476,718.00	4.23
4	300750	宁德时代	445,839.00	3.95
5	603986	兆易创新	434,949.00	3.86
6	601318	中国平安	371,644.00	3.30
7	688981	中芯国际	331,703.23	2.94
8	688008	澜起科技	315,585.51	2.80
9	688347	华虹宏力	304,871.03	2.70
10	600900	长江电力	285,597.00	2.53
11	603259	药明康德	279,329.00	2.48
12	688041	海光信息	278,540.00	2.47
13	300502	新易盛	278,229.00	2.47
14	601211	国泰海通	276,564.54	2.45
15	600919	江苏银行	268,827.00	2.38
16	601398	工商银行	255,799.00	2.27
17	000725	京东方 A	251,778.00	2.23
18	601288	农业银行	247,201.00	2.19
19	600988	赤峰黄金	243,308.00	2.16
20	601600	中国铝业	234,870.00	2.08
21	601668	中国建筑	234,168.00	2.08
22	603993	洛阳钼业	226,588.00	2.01

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	53,641,781.85
卖出股票收入（成交）总额	53,435,000.00

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,317.24
2	应收清算款	32,395.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,245.00

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,957.90

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
279	31,335.57	7,459,596.00	85.32	1,283,028.00	14.68

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 8 月 23 日）基金份额总额	245,742,624.00
本报告期期初基金份额总额	8,742,624.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,742,624.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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(%)	
中信证券	3	90,212,433.51	84.25	13,167.33	84.25	-
国泰海通	3	10,780,247.32	10.07	1,572.53	10.06	-
国信证券	2	6,084,101.02	5.68	888.92	5.69	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
开源证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备

较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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 800 增强策略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 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 13 日
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 2 月 13 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2026 年 3 月 5 日
6	《银华中证 800 增强策略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
7	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 3 月 28 日
8	《银华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
9	《银华中证 800 增强策略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
10	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 4 月 21 日
11	《关于银华基金管理股份有限公司旗下银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告》	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	2026 年 5 月 21 日
12	《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	20260622-20260624	0.00	6,121,500.00	4,628,200.00	1,493,300.00	17.08
	1	20260601-20260601	0.00	6,121,500.00	4,628,200.00	1,493,300.00	17.08
	1	20260526-20260526	0.00	6,121,500.00	4,628,200.00	1,493,300.00	17.08
	1	20260521-20260521	0.00	6,121,500.00	4,628,200.00	1,493,300.00	17.08
	1	20260626-20260628	0.00	6,121,500.00	4,628,200.00	1,493,300.00	17.08
	2	20260101-20260423	3,880,607.00	13,380,200.00	16,922,300.00	338,507.00	3.87
	2	20260508-20260510	3,880,607.00	13,380,200.00	16,922,300.00	338,507.00	3.87
	2	20260514-20260514	3,880,607.00	13,380,200.00	16,922,300.00	338,507.00	3.87
	2	20260519-20260520	3,880,607.00	13,380,200.00	16,922,300.00	338,507.00	3.87
	3	20260408-20260408	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260225-20260226	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260212-20260223	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260116-20260121	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260410-20260412	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260604-20260630	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260528-20260531	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260518-20260519	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28

	3	20260512-20260512	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260507-20260507	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260430-20260505	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	3	20260424-20260427	1,065,226.00	18,407,300.00	16,126,100.00	3,346,426.00	38.28
	4	20260227-20260329	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260224-20260224	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260206-20260209	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260123-20260204	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260101-20260119	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260403-20260409	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32
	4	20260413-20260630	2,125,490.00	11,767,673.00	11,767,300.00	2,125,863.00	24.32

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括：

1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证 800 增强策略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 800 增强策略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 800 增强策略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 800 增强策略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