

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

2025 年 12 月 31 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 3 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2025 年 09 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	41

8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	57
8.8 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	57
8.9 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	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末上市基金前十名持有人	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.4 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	59
§ 10 开放式基金份额变动	60
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	63
12.1 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	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录	64
13.2 存放地点	64
13.3 查阅方式	64

§ 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	424,174,931.00 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	<p>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，从而实现对标指数的紧密跟踪。</p> <p>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。</p>
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
	联系电话	(010) 58163000
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日） - 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	13,248,020.05
本期利润	28,017,691.92
加权平均基金份额本期利润	0.0807
本期加权平均净值利润率	8.25%
本期基金份额净值增长率	0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	142,062.91
期末可供分配基金份额利润	0.0003
期末基金资产净值	424,316,993.91
期末基金份额净值	1.0003
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	0.03%

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。

4、本基金合同生效日为 2025 年 09 月 17 日，主要财务指标的计算期间为自 2025 年 09 月 17 日起

至 2025 年 12 月 31 日止。

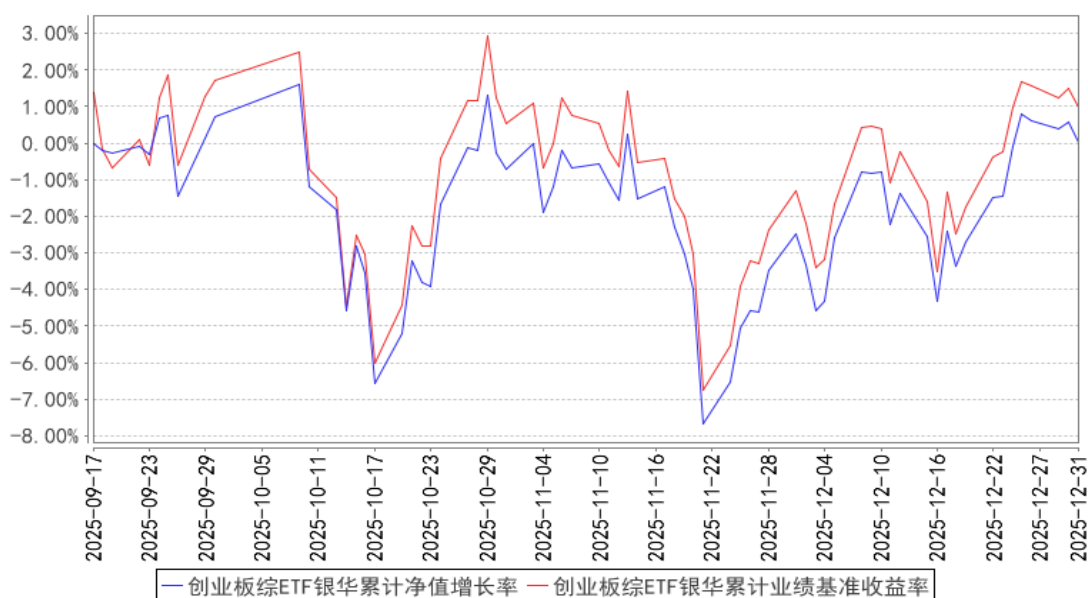
3.2 基金净值表现

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	-0.69%	1.39%	-0.73%	1.46%	0.04%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.03%	1.34%	0.98%	1.45%	-0.95%	-0.11%

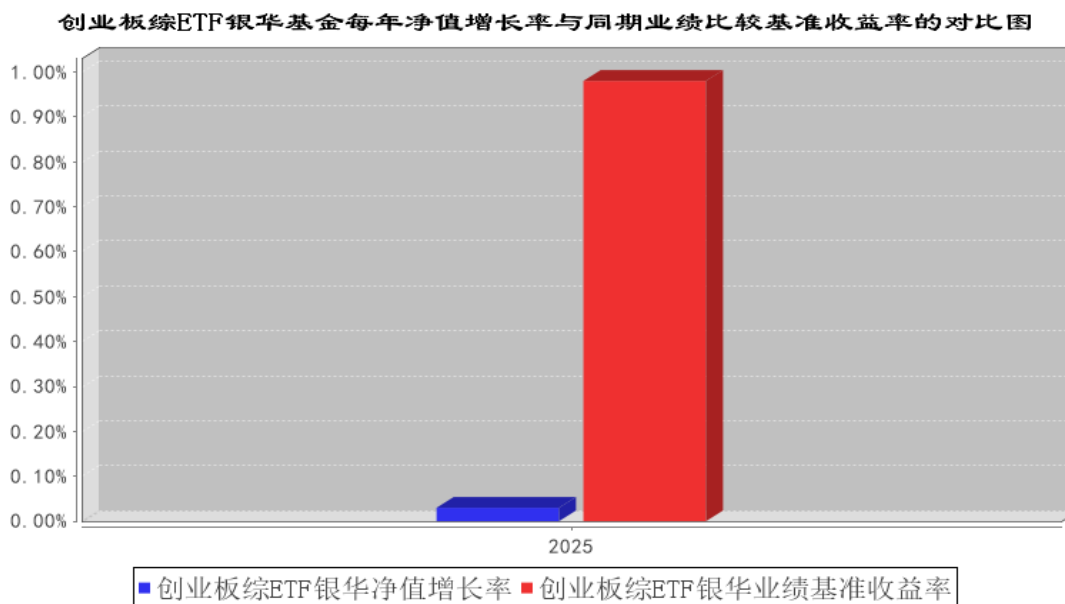
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

创业板综ETF银华累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2025年09月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§ 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2025年底，银华基金管理公募基金242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年起连续五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日起兼任银华华证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。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。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2025 年 9 月 17 日	2025 年 10 月 22 日	12 年	大学本科。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金。现任量化投资部基金经理。自 2025 年 12 月 5 日起担任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2026 年 2 月 10 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 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四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。

4.3.3 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%的情况有2次,原因是量化投资组合投资策略需要,未导致

不公平交易和利益输送。

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

2025 年国内外宏观经济运行呈现出一些新的特征。国内方面，宏观经济继续呈现整体复苏与结构调整态势，新质经济驱动力提升。在消费品国补等政策支撑下，内需消费整体平稳；房地产产业链复苏较弱。此外，AI、科技硬件、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品，体现出新经济的活力提升。国外方面，美联储在降息通道中继续前行，全年三次降低基准利率；而另一方面，全球主要经济体之间的关税贸易政策框架在博弈中渐进成型，不确定性有所收敛但仍存变数。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在 2025 年明显上行。

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 1.0003 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.03%，业绩比较基准收益率为 0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的波动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，国内政策、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，根据法律法规、监管规定和业务发展的需要，持续健全合规管理及监察稽核机制，改进合规管理方式，提高合规管理能力，推进合规文化建设，提升合规管理工作的有效性。

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实基于风险的反洗钱理念，健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处

务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱等方面的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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验。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2025 年 09 月 17 日至 2025 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

4.9 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合规守信、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 托管人对本年度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）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	XYZH/2026BJAB2B0189

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了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“创业板综 ETF 银华”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则及中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了创业板综 ETF 银华 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师独立性准则和中国注册会计师职业道德守则中适用于公众利益实体财务报表审计的独立性要求，我们独立于创业板综 ETF 银华，并履行了独立性和职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用

其他事项	不适用
其他信息	<p>银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括创业板综 ETF 银华 2025 年 9 月 17 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创业板综 ETF 银华的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算创业板综 ETF 银华、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督创业板综 ETF 银华的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会</p>

	<p>计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对创业板综 ETF 银华持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致创业板综 ETF 银华不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	崔巍巍 齐晓瑞
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 8 层
审计报告日期	2026 年 03 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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:2025 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产:		
货币资金	7.4.7.1	4,547,556.36
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	419,942,410.52
其中:股票投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中:债券投资		-

资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
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	7.4.7.8	-
资产总计		424,489,966.88
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
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		80,658.60
应付托管费		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	7.4.7.9	30,000.00
负债合计		172,972.97
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	424,174,931.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	142,062.91
净资产合计		424,316,993.91
负债和净资产总计		424,489,966.88

注：1. 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0003 元，基金份额总额 424,174,931.00 份。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 09 月 17 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 09 月 17 日至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 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：2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		28,287,430.85
1. 利息收入		5,633.44
其中：存款利息收入	7.4.7.13	5,633.44
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）		13,302,893.41
其中：股票投资收益	7.4.7.14	13,137,044.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	165,849.40
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）	7.4.7.20	14,769,671.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	209,232.13
减：二、营业总支出		269,738.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	142,262.94
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	47,420.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	80,055.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,017,691.92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,017,691.92

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		28,017,691.92

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。

7.3 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：2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	244,174,931.00	-	-	244,174,931.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	180,000,000.00	-	142,062.91	180,142,062.91
（一）、综合收益总额	-	-	28,017,691.92	28,017,691.92
（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）	180,000,000.00	-	-27,875,629.01	152,124,370.99
其中：1. 基金申购款	844,000,000.00	-	-33,763,893.55	810,236,106.45
2. 基金赎回款	-664,000,000.00	-	5,888,264.54	-658,111,735.46
（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	424,174,931.00	-	142,062.91	424,316,993.91

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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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，本基金的投资范围主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证，下同）。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。

7.4.2 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”)、中国证监会颁布的《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>》、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《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》和财务报表附注所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分，终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易

日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采取现金分红方式；

3、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后，可酌情调整以上基金收益分配原则和支付方式，并于变更实施日前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	47,110.45
等于：本金	47,105.39
加：应计利息	5.06
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	4,500,445.91
等于：本金	4,500,378.63
加：应计利息	67.28
减：坏账准备	-
合计	4,547,556.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	405,172,738.65	-	419,942,410.52	14,769,671.87
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	405,172,738.65	-	419,942,410.52	14,769,671.87

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	30,000.00
合计	30,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	244,174,931.00	244,174,931.00
本期申购	844,000,000.00	844,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-664,000,000.00	-664,000,000.00
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	424,174,931.00	424,174,931.00

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	13,248,020.05	14,769,671.87	28,017,691.92
本期基金份额交易产生的变动数	-4,299,049.85	-23,576,579.16	-27,875,629.01
其中：基金申购款	-2,378,599.42	-31,385,294.13	-33,763,893.55
基金赎回款	-1,920,450.43	7,808,714.97	5,888,264.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,948,970.20	-8,806,907.29	142,062.91

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	2,962.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,670.98
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,633.44

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	610,046.73
股票投资收益——赎回差价收入	12,526,997.28
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	13,137,044.01

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	102,758,599.51
减：卖出股票成本总额	102,002,968.61
减：交易费用	145,584.17
买卖股票差价收入	610,046.73

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
赎回基金份额对价总额	658,111,735.46
减：现金支付赎回款总额	17,018,335.46
减：赎回股票成本总额	628,566,402.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	12,526,997.28

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	165,849.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	165,849.40

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日

1. 交易性金融资产	14,769,671.87
股票投资	14,769,671.87
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	14,769,671.87

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	207,821.00
其他	1,411.13
合计	209,232.13

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	55.00
其他	50,000.00
合计	80,055.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司
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(“银华创业板综合 ETF 联接”)	基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月17日(基金合同生效日)至2025年12月31
----	--------------------------------------

	日
当期发生的基金应支付的管理费	142,262.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,237.03
应支付基金管理人的净管理费	118,025.91

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：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,420.99

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：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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 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（%）
银华创业板综合ETF联接	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。

7.4.10.6 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 2025年9月17日（基金合同生效日）至2025年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	47,110.45	2,962.46

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	419,942,410.52	98.97
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	419,942,410.52	98.97

7.4.13.4.3.2 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（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	18,869,756.87
业绩比较基准下降5%	-18,869,756.87	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日
第一层次	419,942,410.52
第二层次	-
第三层次	-
合计	419,942,410.52

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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资产和负债主要包括银行存款、其他各类应收款项和其他各类应付款项等。

不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.16 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 26 日经本基金管理人批准报出。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	419,942,410.52	98.93
	其中：股票	419,942,410.52	98.93
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	4,547,556.36	1.07
8	其他各项资产	-	-
9	合计	424,489,966.88	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	4,454,978.00	1.05
B	采矿业	2,612,338.00	0.62
C	制造业	316,727,093.52	74.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,339,116.00	0.32
E	建筑业	364,262.00	0.09
F	批发和零售业	8,891,295.00	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,610,584.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,592,259.00	10.27
J	金融业	14,300,652.00	3.37
K	房地产业	347,990.00	0.08
L	租赁和商务服务业	3,650,252.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	8,796,593.00	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	3,976,928.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	549,820.00	0.13
Q	卫生和社会工作	3,387,751.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	5,340,499.00	1.26
S	综合	-	-
	合计	419,942,410.52	98.97

8.2.2 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。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	95,300	34,999,878.00	8.25
2	300308	中际旭创	29,500	17,995,000.00	4.24
3	300502	新易盛	22,600	9,737,888.00	2.29
4	300059	东方财富	399,000	9,248,820.00	2.18
5	300124	汇川技术	88,300	6,651,639.00	1.57
6	300274	阳光电源	38,600	6,602,144.00	1.56
7	300476	胜宏科技	19,500	5,607,810.00	1.32
8	300760	迈瑞医疗	29,400	5,599,230.00	1.32
9	300433	蓝思科技	149,200	4,516,284.00	1.06
10	300394	天孚通信	18,400	3,735,752.00	0.88
11	300102	乾照光电	119,900	3,304,444.00	0.78
12	301308	江波龙	12,800	3,133,952.00	0.74
13	300803	指南针	22,600	2,957,662.00	0.70
14	300014	亿纬锂能	41,100	2,702,736.00	0.64
15	302132	中航成飞	32,400	2,559,600.00	0.60
16	300251	光线传媒	155,300	2,543,814.00	0.60
17	300661	圣邦股份	36,900	2,532,816.00	0.60
18	300498	温氏股份	138,400	2,336,192.00	0.55
19	301377	鼎泰高科	15,600	2,169,960.00	0.51
20	300115	长盈精密	45,300	2,106,450.00	0.50
21	300033	同花顺	6,500	2,094,170.00	0.49
22	300469	信息发展	31,400	1,940,520.00	0.46
23	300779	惠城环保	14,700	1,912,617.00	0.45
24	300015	爱尔眼科	172,000	1,888,560.00	0.45
25	301626	苏州天脉	10,100	1,881,630.00	0.44
26	301200	大族数控	15,800	1,876,566.00	0.44
27	300327	中颖电子	66,200	1,855,586.00	0.44
28	300570	太辰光	15,700	1,814,135.00	0.43
29	300520	科大国创	51,100	1,782,879.00	0.42
30	300068	南都电源	113,900	1,770,006.00	0.42
31	300184	力源信息	170,300	1,701,297.00	0.40
32	300628	亿联网络	46,000	1,639,900.00	0.39
33	300672	国科微	15,200	1,635,824.00	0.39
34	300604	长川科技	16,000	1,620,960.00	0.38
35	301392	汇成真空	12,500	1,613,000.00	0.38
36	300087	荃银高科	137,700	1,608,336.00	0.38
37	300329	海伦钢琴	98,500	1,594,715.00	0.38
38	300910	瑞丰新材	27,600	1,560,780.00	0.37
39	300232	洲明科技	216,100	1,532,149.00	0.36

40	301269	华大九天	14,400	1,531,152.00	0.36
41	301093	华兰股份	29,800	1,522,780.00	0.36
42	300085	银之杰	37,300	1,495,357.00	0.35
43	300446	航天智造	57,800	1,464,652.00	0.35
44	300118	东方日升	99,800	1,463,068.00	0.34
45	300802	矩子科技	76,100	1,456,554.00	0.34
46	300185	通裕重工	496,300	1,409,492.00	0.33
47	300455	航天智装	46,700	1,402,868.00	0.33
48	300872	天阳科技	67,500	1,387,800.00	0.33
49	300866	安克创新	11,900	1,361,241.00	0.32
50	300790	宇瞳光学	44,900	1,342,959.00	0.32
51	300708	聚灿光电	151,000	1,340,880.00	0.32
52	300199	翰宇药业	74,700	1,337,130.00	0.32
53	300395	菲利华	12,900	1,293,870.00	0.30
54	300300	海峡创新	85,900	1,291,077.00	0.30
55	300001	特锐德	49,800	1,278,864.00	0.30
56	300876	蒙泰高新	35,700	1,259,139.00	0.30
57	300322	硕贝德	46,000	1,255,340.00	0.30
58	301550	斯菱智驱	8,985	1,246,219.50	0.29
59	300164	通源石油	225,200	1,243,104.00	0.29
60	300468	四方精创	32,000	1,242,560.00	0.29
61	300080	易成新能	254,300	1,235,898.00	0.29
62	300408	三环集团	26,600	1,216,950.00	0.29
63	301155	海力风电	15,000	1,213,950.00	0.29
64	300111	向日葵	195,400	1,197,802.00	0.28
65	300045	华力创通	41,300	1,193,983.00	0.28
66	300593	新雷能	39,800	1,184,448.00	0.28
67	300352	北信源	192,000	1,176,960.00	0.28
68	300443	金雷股份	41,500	1,167,395.00	0.28
69	300975	商络电子	91,300	1,158,597.00	0.27
70	300775	三角防务	37,500	1,140,000.00	0.27
71	301087	可孚医疗	25,500	1,139,085.00	0.27
72	300007	汉威科技	21,100	1,130,960.00	0.27
73	300622	博士眼镜	35,900	1,115,054.00	0.26
74	300134	大富科技	88,800	1,110,000.00	0.26
75	300073	当升科技	19,100	1,103,980.00	0.26
76	300759	康龙化成	37,700	1,071,811.00	0.25
77	300573	兴齐眼药	15,100	1,061,379.00	0.25
78	300221	银禧科技	102,200	1,054,704.00	0.25
79	300061	旗天科技	99,900	1,050,948.00	0.25
80	300521	爱司凯	36,300	1,034,550.00	0.24
81	300454	深信服	8,700	1,001,892.00	0.24
82	300120	经纬辉开	117,400	997,900.00	0.24

83	301069	凯盛新材	35,300	981,340.00	0.23
84	300048	合康新能	162,600	967,470.00	0.23
85	300438	鹏辉能源	18,100	963,282.00	0.23
86	301050	雷电微力	18,200	950,040.00	0.22
87	300629	新劲刚	39,900	948,822.00	0.22
88	300842	帝科股份	15,800	936,466.00	0.22
89	300319	麦捷科技	80,100	936,369.00	0.22
90	301021	英诺激光	19,100	929,215.00	0.22
91	301160	翔楼新材	12,800	920,192.00	0.22
92	300034	钢研高纳	46,560	911,644.80	0.21
93	300770	新媒股份	21,300	903,333.00	0.21
94	300548	长芯博创	6,300	894,600.00	0.21
95	301487	盟固利	40,700	892,551.00	0.21
96	300053	航宇微	46,900	892,038.00	0.21
97	300551	古鳌科技	52,300	870,272.00	0.21
98	300364	中文在线	34,300	861,616.00	0.20
99	300475	香农芯创	5,900	851,606.00	0.20
100	300938	信测标准	25,900	844,340.00	0.20
101	300018	中元股份	76,700	843,700.00	0.20
102	300342	天银机电	25,400	841,502.00	0.20
103	300474	景嘉微	11,700	840,879.00	0.20
104	300618	寒锐钴业	18,500	836,385.00	0.20
105	300896	爱美客	5,900	836,148.00	0.20
106	300153	科泰电源	27,900	811,053.00	0.19
107	301611	珂玛科技	9,400	805,862.00	0.19
108	300660	江苏雷利	14,700	805,854.00	0.19
109	300442	润泽科技	15,100	797,280.00	0.19
110	300188	国投智能	54,300	793,323.00	0.19
111	300465	高伟达	38,900	783,057.00	0.18
112	301238	瑞泰新材	37,500	765,000.00	0.18
113	300036	超图软件	42,100	764,536.00	0.18
114	300979	华利集团	15,200	763,192.00	0.18
115	300762	上海瀚讯	18,300	762,744.00	0.18
116	300136	信维通信	12,200	756,400.00	0.18
117	300456	赛微电子	13,500	755,460.00	0.18
118	300503	昊志机电	11,800	751,896.00	0.18
119	300450	先导智能	15,000	749,700.00	0.18
120	301525	儒竞科技	8,500	733,890.00	0.17
121	301005	超捷股份	4,700	729,769.00	0.17
122	300353	东土科技	35,700	726,852.00	0.17
123	300292	吴通控股	159,500	719,345.00	0.17
124	301183	东田微	4,600	713,414.00	0.17
125	300039	上海凯宝	117,200	706,716.00	0.17

126	300401	花园生物	46,400	701,568.00	0.17
127	301358	湖南裕能	10,600	685,396.00	0.16
128	300065	海兰信	37,400	679,558.00	0.16
129	300109	新开源	40,200	674,958.00	0.16
130	301205	联特科技	4,000	674,040.00	0.16
131	300286	安科瑞	29,100	671,628.00	0.16
132	300294	博雅生物	29,600	668,960.00	0.16
133	300223	北京君正	6,300	668,052.00	0.16
134	300360	炬华科技	38,300	666,037.00	0.16
135	300773	拉卡拉	23,300	663,584.00	0.16
136	300348	长亮科技	42,800	662,544.00	0.16
137	300324	旋极信息	109,900	657,202.00	0.15
138	300458	全志科技	15,600	655,668.00	0.15
139	300258	精锻科技	45,600	652,992.00	0.15
140	300463	迈克生物	58,000	649,020.00	0.15
141	300393	中来股份	96,800	648,560.00	0.15
142	300674	宇信科技	26,600	645,316.00	0.15
143	300222	科大智能	58,800	643,272.00	0.15
144	300662	科锐国际	25,300	640,849.00	0.15
145	301263	泰恩康	22,100	640,679.00	0.15
146	300699	光威复材	16,200	639,252.00	0.15
147	300505	川金诺	28,400	635,876.00	0.15
148	300620	光库科技	4,300	632,315.00	0.15
149	300095	华伍股份	52,100	631,452.00	0.15
150	300444	双杰电气	65,300	628,839.00	0.15
151	300679	电连技术	12,900	627,972.00	0.15
152	300088	长信科技	103,400	626,604.00	0.15
153	300777	中简科技	15,300	624,240.00	0.15
154	300008	天海防务	79,000	623,310.00	0.15
155	300031	宝通科技	27,400	622,802.00	0.15
156	300782	卓胜微	7,600	619,248.00	0.15
157	301076	新瀚新材	12,500	616,375.00	0.15
158	300229	拓尔思	30,900	614,910.00	0.14
159	300310	宜通世纪	104,000	614,640.00	0.14
160	300709	精研科技	13,000	613,080.00	0.14
161	301236	软通动力	12,900	611,847.00	0.14
162	300247	融捷健康	119,100	610,983.00	0.14
163	300358	楚天科技	62,400	610,896.00	0.14
164	300529	健帆生物	31,000	609,770.00	0.14
165	300298	三诺生物	35,400	605,694.00	0.14
166	300244	迪安诊断	37,900	600,715.00	0.14
167	300144	宋城演艺	73,100	598,689.00	0.14
168	300870	欧陆通	2,700	596,700.00	0.14

169	300278	华昌达	97,800	596,580.00	0.14
170	300421	力星股份	16,200	595,836.00	0.14
171	300969	恒帅股份	4,800	593,760.00	0.14
172	300855	图南股份	18,300	591,090.00	0.14
173	300315	掌趣科技	119,300	589,342.00	0.14
174	300130	新国都	20,900	579,557.00	0.14
175	300627	华测导航	16,600	579,506.00	0.14
176	301150	中一科技	13,700	575,263.00	0.14
177	300415	伊之密	22,000	573,320.00	0.14
178	300129	泰胜风能	54,800	573,208.00	0.14
179	301161	唯万密封	15,100	571,686.00	0.13
180	301165	锐捷网络	6,400	568,320.00	0.13
181	300471	厚普股份	45,100	568,260.00	0.13
182	300004	南风股份	46,300	567,175.00	0.13
183	300765	新诺威	15,700	566,299.00	0.13
184	300451	创业慧康	116,800	565,312.00	0.13
185	300224	正海磁材	36,500	564,290.00	0.13
186	300213	佳讯飞鸿	58,900	560,728.00	0.13
187	301589	诺瓦星云	3,400	559,470.00	0.13
188	300890	翔丰华	18,700	557,260.00	0.13
189	300731	科创新源	9,900	556,578.00	0.13
190	300350	华鹏飞	88,200	556,542.00	0.13
191	300751	迈为股份	2,700	556,173.00	0.13
192	300685	艾德生物	27,100	554,466.00	0.13
193	300382	斯莱克	35,600	553,936.00	0.13
194	300142	沃森生物	50,700	553,137.00	0.13
195	300191	潜能恒信	29,900	552,552.00	0.13
196	300390	天华新能	10,100	551,561.00	0.13
197	300418	昆仑万维	13,200	550,440.00	0.13
198	300146	汤臣倍健	45,800	550,058.00	0.13
199	300492	华图山鼎	7,400	549,820.00	0.13
200	300595	欧普康视	37,400	549,406.00	0.13
201	301600	慧翰股份	4,200	545,202.00	0.13
202	300681	英搏尔	21,700	543,802.00	0.13
203	300290	荣科科技	19,700	542,341.00	0.13
204	300688	创业黑马	18,500	540,015.00	0.13
205	300058	蓝色光标	46,800	539,136.00	0.13
206	300748	金力永磁	15,800	538,938.00	0.13
207	300026	红日药业	153,000	538,560.00	0.13
208	300403	汉宇集团	37,300	537,493.00	0.13
209	300999	金龙鱼	18,700	537,438.00	0.13
210	301301	川宁生物	52,100	528,294.00	0.12
211	300666	江丰电子	5,700	524,400.00	0.12

212	300827	上能电气	15,300	523,566.00	0.12
213	300738	奥飞数据	28,200	521,418.00	0.12
214	300005	探路者	48,100	520,923.00	0.12
215	300002	神州泰岳	45,000	518,400.00	0.12
216	300820	英杰电气	10,700	513,065.00	0.12
217	301291	明阳电气	12,300	511,803.00	0.12
218	300567	精测电子	5,600	510,720.00	0.12
219	300761	立华股份	24,600	510,450.00	0.12
220	301035	润丰股份	7,500	510,075.00	0.12
221	301095	广立微	7,100	509,141.00	0.12
222	300947	德必集团	25,200	507,528.00	0.12
223	301293	三博脑科	8,600	507,228.00	0.12
224	300347	泰格医药	8,900	504,630.00	0.12
225	300737	科顺股份	91,500	503,250.00	0.12
226	300083	创世纪	54,500	501,945.00	0.12
227	300482	万孚生物	25,400	501,650.00	0.12
228	300619	金银河	11,400	500,460.00	0.12
229	300228	富瑞特装	50,600	500,434.00	0.12
230	300601	康泰生物	33,700	497,749.00	0.12
231	301522	上大股份	12,700	497,459.00	0.12
232	300725	药石科技	12,900	497,424.00	0.12
233	300099	尤洛卡	66,000	496,980.00	0.12
234	301292	海科新源	7,700	495,957.00	0.12
235	300331	苏大维格	15,300	495,108.00	0.12
236	300171	东富龙	31,500	494,550.00	0.12
237	300682	朗新科技	32,300	491,283.00	0.12
238	301115	联检科技	31,000	490,110.00	0.12
239	300497	富祥药业	32,400	489,564.00	0.12
240	300182	捷成股份	88,500	488,520.00	0.12
241	300624	万兴科技	6,900	487,485.00	0.11
242	301123	奕东电子	6,600	485,496.00	0.11
243	301219	腾远钴业	7,100	484,788.00	0.11
244	300569	天能重工	84,400	484,456.00	0.11
245	301027	华蓝集团	26,300	484,183.00	0.11
246	300663	科蓝软件	27,400	483,336.00	0.11
247	300705	九典制药	32,100	480,858.00	0.11
248	301536	星辰科技	8,000	479,280.00	0.11
249	300357	我武生物	16,900	479,115.00	0.11
250	301039	中集车辆	52,300	478,545.00	0.11
251	300832	新产业	8,500	478,125.00	0.11
252	300888	稳健医疗	12,600	476,784.00	0.11
253	300098	高新兴	77,800	474,580.00	0.11
254	300084	海默科技	47,400	473,526.00	0.11

255	300493	润欣科技	23,500	472,115.00	0.11
256	300858	科拓生物	28,100	471,237.00	0.11
257	300339	润和软件	9,500	470,250.00	0.11
258	300024	机器人	25,800	469,302.00	0.11
259	300101	振芯科技	16,500	469,095.00	0.11
260	300785	值得买	10,700	468,874.00	0.11
261	300363	博腾股份	20,100	467,124.00	0.11
262	300984	金沃股份	5,500	466,840.00	0.11
263	300641	正丹股份	26,400	465,960.00	0.11
264	300168	万达信息	72,100	465,766.00	0.11
265	300132	青松股份	53,300	464,243.00	0.11
266	300027	华谊兄弟	213,200	462,644.00	0.11
267	300972	万辰集团	2,300	462,461.00	0.11
268	300989	蕾奥规划	26,100	460,665.00	0.11
269	301316	慧博云通	10,300	460,204.00	0.11
270	300240	飞力达	60,700	457,678.00	0.11
271	300763	锦浪科技	6,400	457,024.00	0.11
272	300638	广和通	15,400	456,456.00	0.11
273	300121	阳谷华泰	36,100	455,582.00	0.11
274	300194	福安药业	101,900	451,417.00	0.11
275	300459	汤姆猫	97,700	448,443.00	0.11
276	300201	海伦哲	65,400	446,682.00	0.11
277	300383	光环新网	35,600	445,356.00	0.10
278	301078	孩子王	42,900	444,873.00	0.10
279	300079	数码视讯	82,300	443,597.00	0.10
280	300591	万里马	44,700	443,424.00	0.10
281	300054	鼎龙股份	11,700	439,920.00	0.10
282	300525	博思软件	30,800	434,280.00	0.10
283	300067	安诺其	86,800	434,000.00	0.10
284	300296	利亚德	68,300	431,656.00	0.10
285	300075	数字政通	28,100	431,054.00	0.10
286	300012	华测检测	31,700	429,535.00	0.10
287	300572	安车检测	15,100	429,293.00	0.10
288	300766	每日互动	13,100	429,287.00	0.10
289	300346	南大光电	10,000	429,000.00	0.10
290	300489	光智科技	8,400	426,720.00	0.10
291	300049	福瑞医科	6,000	422,460.00	0.10
292	301058	中粮科工	38,500	421,960.00	0.10
293	300128	锦富技术	57,500	419,750.00	0.10
294	300586	美联新材	38,400	418,176.00	0.10
295	300580	贝斯特	15,900	418,011.00	0.10
296	300072	海新能科	90,500	416,300.00	0.10
297	301127	武汉天源	27,400	416,206.00	0.10

298	300349	金卡智能	26,600	415,758.00	0.10
299	300209	行云科技	76,100	414,745.00	0.10
300	301297	富乐德	11,500	411,700.00	0.10
301	300918	南山智尚	22,100	410,839.00	0.10
302	300181	佐力药业	25,400	410,464.00	0.10
303	300783	三只松鼠	17,700	409,755.00	0.10
304	300174	元力股份	26,400	409,200.00	0.10
305	300435	中泰股份	18,400	408,848.00	0.10
306	300634	彩讯股份	16,200	408,726.00	0.10
307	300207	欣旺达	15,500	405,325.00	0.10
308	300857	协创数据	2,400	404,832.00	0.10
309	301217	铜冠铜箔	11,800	404,504.00	0.10
310	300635	中达安	25,200	403,956.00	0.10
311	300676	华大基因	8,900	403,704.00	0.10
312	300400	劲拓股份	20,200	399,960.00	0.09
313	300255	常山药业	6,400	397,440.00	0.09
314	300623	捷捷微电	14,600	396,682.00	0.09
315	300180	华峰超纤	57,200	396,396.00	0.09
316	300046	台基股份	11,400	395,580.00	0.09
317	300323	华灿光电	49,400	394,212.00	0.09
318	300253	卫宁健康	44,600	393,372.00	0.09
319	300179	四方达	26,000	393,120.00	0.09
320	300161	华中数控	13,500	392,040.00	0.09
321	300140	节能环境	57,800	391,306.00	0.09
322	300973	立高食品	9,100	391,300.00	0.09
323	300143	盈康生命	39,600	391,248.00	0.09
324	300193	佳士科技	43,400	388,430.00	0.09
325	300368	汇金股份	25,600	388,096.00	0.09
326	300287	飞利信	79,000	386,310.00	0.09
327	300633	开立医疗	14,600	385,732.00	0.09
328	300133	华策影视	46,300	385,216.00	0.09
329	300747	锐科激光	14,200	383,826.00	0.09
330	300926	博俊科技	11,700	383,526.00	0.09
331	300470	中密控股	10,200	383,520.00	0.09
332	301031	中熔电气	3,400	381,446.00	0.09
333	300100	双林股份	9,600	380,352.00	0.09
334	300010	豆神教育	52,100	377,204.00	0.09
335	300013	新宁物流	95,600	376,664.00	0.09
336	300160	秀强股份	69,200	376,448.00	0.09
337	300879	大叶股份	12,600	376,110.00	0.09
338	300354	东华测试	8,200	373,100.00	0.09
339	300226	上海钢联	14,800	371,776.00	0.09
340	300496	中科创达	5,500	371,250.00	0.09

341	300307	慈星股份	52,400	370,468.00	0.09
342	300077	国民技术	18,300	370,026.00	0.09
343	301307	美利信	10,700	370,006.00	0.09
344	300814	中富电路	5,000	369,700.00	0.09
345	300413	芒果超媒	15,100	368,742.00	0.09
346	300113	顺网科技	18,200	368,368.00	0.09
347	300687	赛意信息	16,000	367,520.00	0.09
348	300718	长盛轴承	4,300	367,048.00	0.09
349	300677	英科医疗	9,400	365,660.00	0.09
350	300021	大禹节水	79,200	364,320.00	0.09
351	300811	铂科新材	5,100	363,681.00	0.09
352	301526	国际复材	51,900	363,300.00	0.09
353	300003	乐普医疗	22,900	362,049.00	0.09
354	300200	高盟新材	30,800	360,668.00	0.08
355	300592	华凯易佰	33,100	359,466.00	0.08
356	300217	东方电热	69,000	357,420.00	0.08
357	300236	上海新阳	5,600	357,056.00	0.08
358	300009	安科生物	37,200	356,004.00	0.08
358	300693	盛弘股份	9,300	356,004.00	0.08
359	300821	东岳硅材	30,400	354,464.00	0.08
360	300684	中石科技	7,200	354,384.00	0.08
361	300261	雅本化学	52,600	353,998.00	0.08
362	300122	智飞生物	18,600	350,982.00	0.08
363	301305	朗坤科技	15,600	350,532.00	0.08
364	300657	弘信电子	12,600	348,516.00	0.08
365	300917	特发服务	8,900	347,990.00	0.08
366	300846	首都在线	15,200	347,016.00	0.08
367	300170	汉得信息	18,300	346,236.00	0.08
368	300487	蓝晓科技	5,600	345,800.00	0.08
369	300862	蓝盾光电	15,100	345,488.00	0.08
370	300758	七彩化学	27,200	345,168.00	0.08
371	301368	丰立智能	5,500	344,685.00	0.08
372	300483	首华燃气	24,200	343,156.00	0.08
373	300563	神宇股份	9,300	341,124.00	0.08
374	301510	固高科技	9,100	340,795.00	0.08
375	300196	长海股份	23,400	340,704.00	0.08
376	301171	易点天下	8,400	340,200.00	0.08
377	300259	新天科技	76,600	340,104.00	0.08
378	300378	鼎捷数智	7,500	339,450.00	0.08
379	300772	运达股份	17,800	339,268.00	0.08
380	300212	易华录	19,400	338,530.00	0.08
381	300587	天铁科技	55,200	338,376.00	0.08
382	301488	豪恩汽电	2,200	336,710.00	0.08

383	300384	三联虹普	20,700	336,375.00	0.08
384	300953	震裕科技	2,000	336,040.00	0.08
385	300302	同有科技	18,500	335,590.00	0.08
386	300047	天源迪科	26,700	335,085.00	0.08
387	300963	中洲特材	16,100	334,558.00	0.08
388	301175	中科环保	56,600	334,506.00	0.08
389	300735	光弘科技	13,400	333,124.00	0.08
390	301061	匠心家居	3,500	331,800.00	0.08
391	300210	森远股份	37,200	330,708.00	0.08
392	300037	新宙邦	6,300	330,120.00	0.08
393	300490	华自科技	27,400	328,526.00	0.08
394	300303	聚飞光电	48,000	328,320.00	0.08
395	300276	三丰智能	33,800	327,860.00	0.08
396	301389	隆扬电子	6,000	327,480.00	0.08
397	301345	涛涛车业	1,300	326,716.00	0.08
398	301382	蜂助手	9,200	326,048.00	0.08
399	300825	阿尔特	33,500	324,280.00	0.08
400	300057	万顺新材	56,900	323,761.00	0.08
401	300411	金盾股份	27,900	323,361.00	0.08
402	300537	广信材料	14,800	323,084.00	0.08
403	300678	中科信息	10,500	322,980.00	0.08
404	300883	龙利得	47,800	322,650.00	0.08
405	300863	卡倍亿	6,400	322,560.00	0.08
406	300602	飞荣达	9,700	321,652.00	0.08
407	300416	苏试试验	18,000	321,120.00	0.08
408	300925	法本信息	15,100	320,724.00	0.08
409	300881	盛德鑫泰	9,400	318,284.00	0.08
410	300149	睿智医药	33,200	317,392.00	0.07
411	300596	利安隆	7,500	316,575.00	0.07
412	300767	震安科技	15,200	316,160.00	0.07
413	300613	富瀚微	6,800	313,208.00	0.07
414	300911	亿田智能	9,400	313,020.00	0.07
415	300373	扬杰科技	4,600	312,800.00	0.07
416	301413	安培龙	2,300	310,040.00	0.07
417	300019	硅宝科技	15,000	309,750.00	0.07
418	300607	拓斯达	9,400	309,636.00	0.07
419	300233	金城医药	22,100	309,179.00	0.07
420	301007	德迈仕	7,600	307,952.00	0.07
421	300158	振东制药	52,600	305,606.00	0.07
422	300776	帝尔激光	4,900	304,486.00	0.07
423	300757	罗博特科	1,300	303,290.00	0.07
424	300056	中创环保	36,700	301,674.00	0.07
425	300671	富满微	9,400	299,766.00	0.07

426	300166	东方国信	29,200	298,424.00	0.07
427	301080	百普赛斯	5,500	297,000.00	0.07
428	300680	隆盛科技	5,300	296,111.00	0.07
429	300172	中电环保	54,000	294,300.00	0.07
430	300135	宝利国际	74,200	293,090.00	0.07
431	300320	海达股份	31,400	292,962.00	0.07
432	301128	强瑞技术	2,900	292,639.00	0.07
433	301018	申菱环境	4,600	292,192.00	0.07
434	300957	贝泰妮	7,300	289,153.00	0.07
435	300867	圣元环保	15,100	287,806.00	0.07
436	300576	容大感光	7,400	285,270.00	0.07
437	300598	诚迈科技	6,200	285,014.00	0.07
438	300558	贝达药业	6,098	284,715.62	0.07
439	300806	斯迪克	9,200	282,808.00	0.07
440	300203	聚光科技	17,800	282,308.00	0.07
441	301606	绿联科技	4,800	281,952.00	0.07
442	300284	苏交科	35,700	281,316.00	0.07
443	300263	隆华科技	31,800	281,112.00	0.07
444	300990	同飞股份	3,100	279,465.00	0.07
445	300893	松原安全	11,740	277,533.60	0.07
446	301376	致欧科技	15,300	276,471.00	0.07
447	300930	屹通新材	9,300	276,210.00	0.07
448	300568	星源材质	18,100	276,025.00	0.07
449	300022	吉峰科技	35,100	274,482.00	0.06
450	300131	英唐智控	18,700	274,142.00	0.06
451	301196	唯科科技	3,400	273,938.00	0.06
452	300648	星云股份	5,300	273,374.00	0.06
453	300429	强力新材	20,500	273,265.00	0.06
454	300948	冠中生态	12,500	271,125.00	0.06
455	301004	嘉益股份	5,200	270,660.00	0.06
456	300017	网宿科技	26,400	270,600.00	0.06
457	300420	五洋自控	67,600	269,724.00	0.06
458	300304	云意电气	23,100	268,884.00	0.06
459	300070	碧水源	68,100	266,952.00	0.06
460	300398	飞凯材料	11,900	266,679.00	0.06
461	300197	节能铁汉	149,800	265,146.00	0.06
462	300616	尚品宅配	19,000	264,670.00	0.06
463	300507	苏奥传感	28,700	263,753.00	0.06
464	300652	雷迪克	4,800	263,328.00	0.06
465	300285	国瓷材料	9,600	263,136.00	0.06
466	301511	德福科技	7,300	261,267.00	0.06
467	300541	先进数通	17,300	260,538.00	0.06
468	300252	金信诺	17,800	260,236.00	0.06

469	300729	乐歌股份	19,100	259,951.00	0.06
470	301209	联合化学	2,300	259,647.00	0.06
471	300919	中伟新材	5,600	259,448.00	0.06
472	301109	军信股份	17,000	255,000.00	0.06
473	300664	鹏鹞环保	47,400	254,064.00	0.06
474	300841	康华生物	3,500	252,910.00	0.06
475	301325	曼恩斯特	5,000	252,750.00	0.06
476	301101	明月镜片	6,100	252,723.00	0.06
477	300480	光力科技	15,100	252,321.00	0.06
478	300809	华辰装备	6,600	251,262.00	0.06
479	301259	艾布鲁	7,600	251,180.00	0.06
480	300655	晶瑞电材	15,500	250,015.00	0.06
481	300436	广生堂	2,800	249,620.00	0.06
482	301029	怡合达	9,400	249,288.00	0.06
483	300151	昌红科技	16,500	248,820.00	0.06
484	300204	舒泰神	9,100	248,612.00	0.06
485	301498	乖宝宠物	3,800	247,570.00	0.06
486	300432	富临精工	14,800	247,160.00	0.06
487	300769	德方纳米	5,600	246,456.00	0.06
488	300457	赢合科技	8,800	245,080.00	0.06
489	301110	青木科技	3,700	244,866.00	0.06
490	300756	金马游乐	4,300	244,584.00	0.06
491	301071	力量钻石	6,800	243,712.00	0.06
492	300740	水羊股份	10,100	240,784.00	0.06
493	300724	捷佳伟创	2,500	239,000.00	0.06
494	300257	开山股份	17,000	238,850.00	0.06
495	301529	福赛科技	2,100	237,510.00	0.06
496	300355	蒙草生态	58,300	235,532.00	0.06
497	300539	横河精密	5,600	235,312.00	0.06
498	300066	三川智慧	37,100	231,133.00	0.05
499	300547	川环科技	5,800	228,520.00	0.05
500	300861	美畅股份	15,300	228,429.00	0.05
501	300041	回天新材	20,600	228,248.00	0.05
502	300499	高澜股份	7,400	227,032.00	0.05
503	300723	一品红	6,700	224,785.00	0.05
504	300388	节能国祯	27,900	224,316.00	0.05
505	300792	壹网壹创	7,900	223,649.00	0.05
506	300260	新莱应材	3,900	221,871.00	0.05
507	300035	中科电气	10,400	221,416.00	0.05
508	300332	天壕能源	42,100	219,762.00	0.05
509	300873	海晨股份	10,000	219,700.00	0.05
510	300145	南方泵业	46,500	219,480.00	0.05
511	300850	新强联	5,300	219,261.00	0.05

512	300055	万邦达	26,700	217,605.00	0.05
513	300582	英飞特	13,400	213,998.00	0.05
514	300430	诚益通	11,100	213,342.00	0.05
515	300501	海顺新材	13,900	212,948.00	0.05
516	300611	美力科技	7,800	212,628.00	0.05
517	300351	永贵电器	11,600	209,148.00	0.05
518	300486	东杰智能	10,500	205,905.00	0.05
519	301000	肇民科技	5,100	200,787.00	0.05
520	300536	农尚环境	27,000	195,750.00	0.05
521	300839	博汇股份	15,700	189,028.00	0.04
522	300293	蓝英装备	8,900	187,968.00	0.04
523	300316	晶盛机电	5,100	187,425.00	0.04
524	300092	科新机电	11,700	184,743.00	0.04
525	301091	深城交	6,900	184,506.00	0.04
526	301013	利和兴	6,200	173,662.00	0.04
527	300409	道氏技术	7,700	173,173.00	0.04
528	301096	百诚医药	3,000	171,420.00	0.04
529	300712	永福股份	6,400	168,512.00	0.04
530	300177	中海达	14,600	150,818.00	0.04
531	301120	新特电气	8,600	148,522.00	0.04
532	300815	玉禾田	6,300	143,514.00	0.03
533	300793	佳禾智能	8,100	132,111.00	0.03
534	300703	创源股份	5,400	131,976.00	0.03
535	300700	岱勒新材	10,200	125,970.00	0.03
536	300993	玉马科技	8,200	120,704.00	0.03
537	301216	万凯新材	7,000	118,020.00	0.03
538	300553	集智股份	2,800	113,092.00	0.03
539	301038	深水规院	4,700	110,215.00	0.03
540	300256	星星科技	26,000	104,780.00	0.02
541	300491	通合科技	3,700	92,981.00	0.02
542	301363	美好医疗	3,500	84,175.00	0.02
543	300248	新开普	6,600	81,906.00	0.02
544	300484	蓝海华腾	3,800	72,390.00	0.02
545	300631	久吾高科	2,300	66,447.00	0.02
546	300341	麦克奥迪	3,700	60,458.00	0.01
547	300441	鲍斯股份	7,600	57,380.00	0.01
548	300859	西域旅游	1,200	44,364.00	0.01
549	301338	凯格精机	500	44,055.00	0.01
550	301268	铭利达	2,400	43,752.00	0.01
551	301335	天元宠物	1,500	43,260.00	0.01
552	300266	兴源环境	14,500	37,265.00	0.01
553	301486	致尚科技	300	37,215.00	0.01
554	300473	德尔股份	1,200	35,736.00	0.01

555	300727	润禾材料	1,000	35,640.00	0.01
556	300945	曼卡龙	2,200	35,552.00	0.01
557	300829	金丹科技	2,100	34,839.00	0.01
558	300157	新锦动力	7,600	34,504.00	0.01
559	300913	兆龙互连	600	31,578.00	0.01
560	300669	沪宁股份	1,200	31,560.00	0.01
561	301505	苏州规划	1,300	28,951.00	0.01
562	300016	北陆药业	3,600	28,584.00	0.01
563	300370	安控科技	10,900	28,449.00	0.01
564	300733	西菱动力	1,500	28,185.00	0.01
565	301396	宏景科技	400	26,520.00	0.01
566	300328	宜安科技	1,500	25,605.00	0.01
567	301397	溯联股份	600	20,898.00	0.00
568	300410	正业科技	1,800	14,724.00	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	23,445,613.30	5.53
2	300308	中际旭创	7,573,181.00	1.78
3	300059	东方财富	5,723,159.00	1.35
4	300033	同花顺	5,223,922.00	1.23
5	300502	新易盛	5,083,490.00	1.20
6	300760	迈瑞医疗	4,625,088.00	1.09
7	300476	胜宏科技	3,737,495.00	0.88
8	300124	汇川技术	3,323,983.00	0.78
9	300274	阳光电源	3,128,708.60	0.74
10	300498	温氏股份	2,426,911.00	0.57
11	300896	爱美客	2,403,358.88	0.57
12	300433	蓝思科技	2,370,605.00	0.56
13	300102	乾照光电	2,296,547.00	0.54
14	300255	常山药业	2,229,369.00	0.53
15	300803	指南针	2,071,758.00	0.49
16	300779	惠城环保	2,064,717.00	0.49
17	300408	三环集团	1,921,085.00	0.45
18	300394	天孚通信	1,918,886.00	0.45
19	300014	亿纬锂能	1,889,966.00	0.45
20	301308	江波龙	1,791,656.00	0.42

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300475	香农芯创	1,997,402.00	0.47
2	300033	同花顺	1,886,629.00	0.44
3	301200	大族数控	1,125,216.00	0.27
4	300255	常山药业	1,108,795.00	0.26
5	300308	中际旭创	1,061,100.00	0.25
6	300672	国科微	970,298.95	0.23
7	300666	江丰电子	937,345.00	0.22
8	300896	爱美客	863,391.00	0.20
9	300408	三环集团	838,146.00	0.20
10	300573	兴齐眼药	821,208.00	0.19
11	300750	宁德时代	791,996.00	0.19
12	300811	铂科新材	733,694.00	0.17
13	300760	迈瑞医疗	731,546.00	0.17
14	300548	长芯博创	711,164.00	0.17
15	301031	中熔电气	710,426.00	0.17
16	300763	锦浪科技	687,284.00	0.16
17	300331	苏大维格	682,814.00	0.16
18	300223	北京君正	667,988.00	0.16
19	300567	精测电子	661,103.00	0.16
20	301600	慧翰股份	655,696.00	0.15

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。

8.4.3 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	345,791,600.98
卖出股票收入（成交）总额	102,758,599.51

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 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。

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
1,390	305,161.82	338,600,157.00	79.83	85,574,774.00	20.17

9.1.2 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	328,780,908.00	77.51

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	UBS AG	3,034,360.00	0.72
2	方正证券股份有限公司	2,949,930.00	0.70
3	招商证券股份有限公司	2,025,272.00	0.48
4	呼云	2,000,116.00	0.47
5	肖锦芳	2,000,038.00	0.47
6	任东平	1,902,346.00	0.45
7	邵帼仪	1,800,262.00	0.42
8	邹冀	1,386,689.00	0.33
9	吴白云	1,200,023.00	0.28
10	杜平	1,171,543.00	0.28
11	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	328,780,908.00	77.51

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 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。

9.4 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。

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	844,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	664,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	424,174,931.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，徐波先生自 2025 年 4 月 24 日起担任本基金管理人副总经理职务。

11.2.2 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，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是信永中和会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 30,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 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。

11.6.4 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	448,550,200.49	100.00	65,450.99	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。

4、本基金合同生效日为 2025 年 09 月 17 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

11.7.2 基金租用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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总 额的比例 (%)
国投证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 28 日
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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 28 日
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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 28 日
4	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2025 年 8 月 28 日
5	《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及招募说明书提示性公告》	中国证券报	2025 年 8 月 28 日
6	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 28 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于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生效的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2025 年 9 月 18 日
8	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 23 日
9	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告》	中国证券报	2025 年 9 月 23 日
10	《银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2025 年 9 月 23 日
11	《关于银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金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, 中国证券报	2025 年 9 月 26 日
12	《关于银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2025 年 9 月 26 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于增	本基金管理人网站, 中	2025 年 11 月 14 日

	加湘财证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	国证监会基金电子披露网站, 证券时报, 中国证券报, 证券日报	
14	《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	2025 年 12 月 26 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20251113-20251231	0.00	811,065,408.00	482,284,500.00	328,780,908.00	77.51

产品特有风险

投资人在投资本基金时, 将面临本基金的特定风险, 具体包括:

- 1) 当基金份额集中度较高时, 少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高, 其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权;
- 2) 在极端情况下, 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元, 进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金, 其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会;
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 更容易触发巨额赎回条款, 基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券, 可能造成证券价格波动, 导致本基金的收益水平发生波动。同时, 巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提, 会导致基金份额净值出现大幅波动;
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时, 本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下, 该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%, 该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《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》
- 13.1.3 《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》
- 13.1.4 《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》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 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。

13.3 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3月28日