

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 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	6
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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	48

8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	65
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	65
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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§ 10 开放式基金份额变动.....	67
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	银华 MSCI
场内简称	银华 MSCI
基金主代码	512380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	228,805,582.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 4 月 30 日

注：本基金的扩位证券简称为：MSCI 中国指数 ETF

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>本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。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比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金财产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股人民币指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95588
传真		(010) 58163027	(010) 66105798
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 55 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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	2020 年	2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日） -2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	192,714,385.94	-21,149,034.94
本期利润	173,356,948.47	53,179,234.45
加权平均基金份额本期利润	0.3044	0.0290
本期加权平均净值利润率	27.53%	2.98%
本期基金份额净值增长率	40.67%	4.64%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末

期末可供分配利润	107,998,319.23	-13,482,590.83
期末可供分配基金份额利润	0.4720	-0.0100
期末基金资产净值	336,803,901.23	1,416,592,836.21
期末基金份额净值	1.4720	1.0464
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	47.20%	4.64%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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。

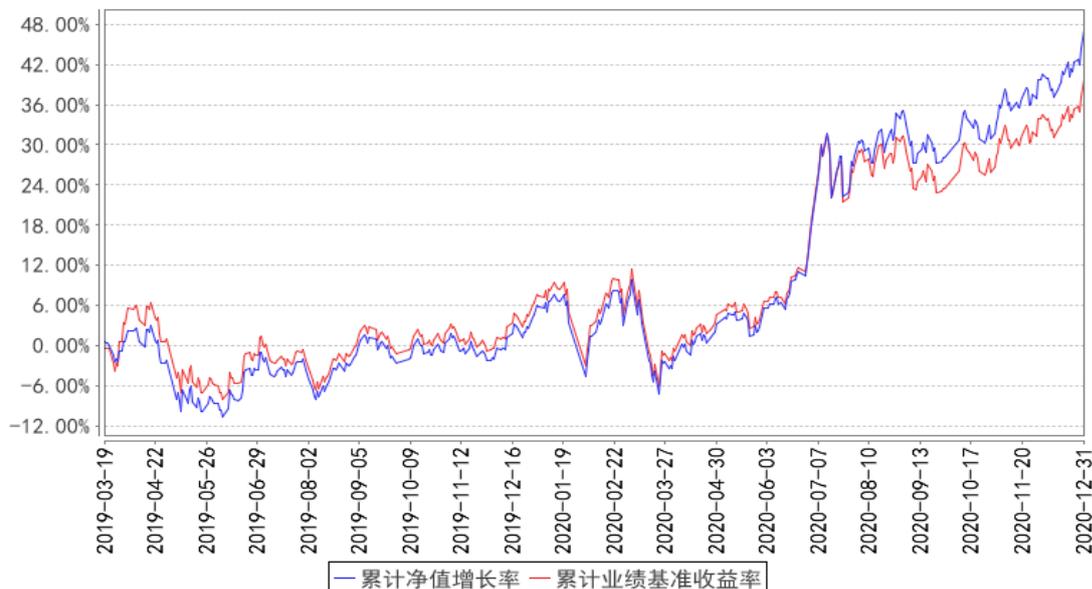
3.2 基金净值表现

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	14.90%	1.01%	13.11%	1.01%	1.79%	0.00%
过去六个月	31.21%	1.35%	24.20%	1.34%	7.01%	0.01%
过去一年	40.67%	1.43%	31.41%	1.43%	9.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	47.20%	1.29%	39.77%	1.31%	7.43%	-0.02%

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

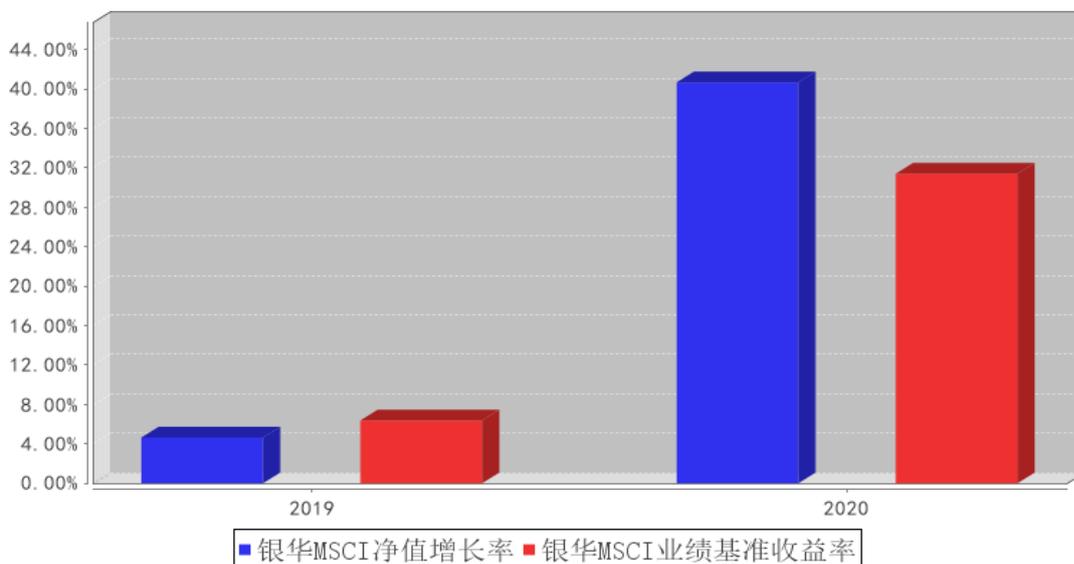
银华MSCI累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

银华MSCI基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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2020年以及2019年3月19日（基金合同生效日）至2019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

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7号文）设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2.222亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司44.10%，第一创业证券股份有限公司26.10%，东北证券股份有限公司18.90%，山西海鑫实业有限公司0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至2020年12月31日，本基金管理人管理着133只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）、银华深证100指数分级证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦30股票

型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、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、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票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、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深

证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华长江经济带主题债券型证券投资基金。同时, 本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

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		
周鹏生	本基金的基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	12.5 年	硕士学位。毕业于中国人民大学。2008 年 7 月加盟银华基金管理有限公司, 曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职, 自 2011 年 9 月 26 日起至 2014 年 1 月 6 日期间担任银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2012 年 8 月 23 日至 2020 年 11 月 26 日兼任上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2012 年 8 月 29 日至 2021 年 1 月 7 日兼任银华上证 50 等

					权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,自2013年5月22日至2016年4月25日兼任银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金经理,自2014年1月7日至2018年3月7日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金(由银华沪深300指数证券投资基金(LOF)转型)基金经理,自2016年1月14日至2018年3月7日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理,自2017年9月15日至2018年12月26日兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自2017年11月9日至2018年12月26日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自2018年1月18日起兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理,自2018年10月22日起兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年11月15日起兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,自2019年3月19日起兼任银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2019年6月5日起兼任银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
张亦驰先生	本基金的基金经理助理	2019年5月28日	-	6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,现任基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2019年5月28日	-	9.5年	学士学位,曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012年8月加入银华基金,历任量化投资部助理量化研究员,现任基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
刘文魁先生	本基金的基金经理助理	2019年8月8日	-	7年	硕士学位。曾就职于艾派迪财团、佛罗里达大学商学院、华夏基金管理有限公司。2015年5月加入银华基金,历任量化投资部量化研究员,现任基金经理助理。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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

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 MSCI 中国 A 股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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、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。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,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》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,制定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的日常监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不掺杂任何的人为判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,

执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。

在投资决策环节，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期检查，并对发现的问题进行及时报告。

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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 1 次，原因是指数型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

我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平，并取得一定的相对收益。

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 1.4720；本报告期基金份额净值增长率为 40.67%，同期业绩比较基准收益率为 31.41%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.20% 之内，年化跟踪误差控制在 2% 之内。

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 2021 年，我们对市场持谨慎乐观态度。

宏观经济层面，新冠疫情成为 2020 年全球经济的最大预期外变量。随着疫情在国内快速得到控制，国内经济得以在较短时间内逐步推进复苏。全年来看，虽然有局部的零星疫情复发，但均没有改变全国范围内复工复产的整体格局。而在国际层面，疫情的控制程度显著劣于国内。在这种国内国外疫情控制的“剪刀差”背景下，全球范围内正在发生产业链的潜在重构，而中国产业链显著受益。在上述因素的作用下，下半年以来出口数据持续超预期。进入 2021 年之后，我们认为全球产业链重构仍将是全球经济版图变化的重要驱动因素。

企业估值层面，我们认为 2020 年全球市场的良好表现，与疫情背景下的各大央行货币宽松高度关联。至于 A 股市场，则是同时受益于居民资产配置方式转变、海外资金流入与全球产业链重构等多重因素的共振。进入 2021 年之后，我们认为这些影响因素仍将持续发挥作用。风险层面，我们认为 2021 年的主要风险来自于海外流动性状况的变化、海外疫情控制与全球范围内的地缘摩擦事件。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了监察稽核机制，根据不同基金的特点与公司业务发展情况，及时界定新的合规风险点，并在年初制定监察稽核工作计划及重点，以专项检查或抽查的形式对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务环节进

行检查。

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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,本基金托管人在对银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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	德师报(审)字(21)第 P01394 号

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体持有人:
审计意见	我们审计了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)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和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度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。

	<p>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职业道德守则，我们独立于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金，并履行了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。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
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。其他信息包括银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>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和中国证券监督管理委员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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、终止经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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</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，</p>

	<p>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，就可能对银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	郝琪 杨婧
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2021 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,360,723.47	8,314,826.53
结算备付金		639,631.24	241,467.36
存出保证金		90,775.27	155,080.36
交易性金融资产	7.4.7.2	334,392,157.85	1,410,107,264.72
其中：股票投资		334,392,157.85	1,410,107,264.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,982,340.43	367,502.35
应收利息	7.4.7.5	1,003.37	2,105.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		343,466,631.63	1,419,188,246.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		5,328,409.23	746,024.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		147,035.00	595,371.97
应付托管费		29,407.00	119,074.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	216,017.59	352,460.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	941,861.58	782,478.71
负债合计		6,662,730.40	2,595,410.57
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	228,805,582.00	1,353,805,582.00
未分配利润	7.4.7.10	107,998,319.23	62,787,254.21
所有者权益合计		336,803,901.23	1,416,592,836.21
负债和所有者权益总计		343,466,631.63	1,419,188,246.78

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4720 元，基金份额总额 228,805,582.00 份。

2、上年度可比期间为 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020年1月1日至2020年12月31日	2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年12月31日
一、收入		180,142,894.07	67,983,035.75
1. 利息收入		61,887.73	860,529.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	61,803.87	860,529.13
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		-	-
证券出借利息收入		83.86	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		197,416,115.43	-8,485,896.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	189,667,237.61	-45,641,129.12
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	7,748,877.82	37,155,232.83
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-19,357,437.47	74,328,269.39
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	2,022,328.38	1,280,133.52
减：二、费用		6,785,945.60	14,803,801.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,210,731.10	7,024,787.04
2. 托管费	7.4.10.2.2	642,146.23	1,404,957.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,286,006.94	5,520,403.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.31	-
7. 其他费用	7.4.7.20	647,061.02	853,653.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		173,356,948.47	53,179,234.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”		173,356,948.47	53,179,234.45

号填列)			
------	--	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,353,805,582.00	62,787,254.21	1,416,592,836.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,356,948.47	173,356,948.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,125,000,000.00	-128,145,883.45	-1,253,145,883.45
其中：1. 基金申购款	414,000,000.00	65,516,189.76	479,516,189.76
2. 基金赎回款	-1,539,000,000.00	-193,662,073.21	-1,732,662,073.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	228,805,582.00	107,998,319.23	336,803,901.23
项目	上年度可比期间 2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,058,805,582.00	-	2,058,805,582.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,179,234.45	53,179,234.45
三、本期基金份额	-705,000,000.00	9,608,019.76	-695,391,980.24

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	645,000,000.00	-12,162,223.46	632,837,776.54
2. 基金赎回款	-1,350,000,000.00	21,770,243.22	-1,328,229,756.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,353,805,582.00	62,787,254.21	1,416,592,836.21

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2018]1209 号文批准公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 2,058,805,582.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)正式生效。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》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。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比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金财产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板股票、创业板

股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括定期存款、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、股指期货、权证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。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股人民币指数,英文全称为: MSCI China A RMB Index, 指数代码为: 718711。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

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个单位的金融资产(负债),并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产

的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无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。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。贷款和应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量,公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益,贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的,将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为:

第一层次:输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次:输入值是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:输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

1. 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值；

(3) 流通受限股票的估值

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2. 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大

变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3. 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4. 分离交易可转债

(1) 分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中的相关原则进行估值。

5. 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量

的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配；

(2) 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；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 本基金收益分配采取现金分红方式；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转

让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	6,360,723.47	8,314,826.53
定期存款	-	-
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	-	-
合计	6,360,723.47	8,314,826.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	279,421,325.93	334,392,157.85	54,970,831.92
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	279,421,325.93	334,392,157.85	54,970,831.92
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,335,778,995.33	1,410,107,264.72	74,328,269.39
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	1,335,778,995.33	1,410,107,264.72	74,328,269.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	641.80	1,909.11
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	316.58	119.57
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	44.99	76.78
合计	1,003.37	2,105.46

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	216,017.59	352,460.49
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	216,017.59	352,460.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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	-	-
预提费用	170,000.00	80,000.00
应付指数使用费	771,861.58	702,478.71
合计	941,861.58	782,478.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,353,805,582.00	1,353,805,582.00
本期申购	414,000,000.00	414,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,539,000,000.00	-1,539,000,000.00
- 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	228,805,582.00	228,805,582.00

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 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	-13,482,590.83	76,269,845.04	62,787,254.21
本期利润	192,714,385.94	-19,357,437.47	173,356,948.47
本期基金份额交易产生的变动数	-64,338,734.22	-63,807,149.23	-128,145,883.45
其中：基金申购款	80,214,644.23	-14,698,454.47	65,516,189.76
基金赎回款	-144,553,378.45	-49,108,694.76	-193,662,073.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,893,060.89	-6,894,741.66	107,998,319.23

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	47,254.76	824,956.27
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	12,679.44	31,767.28
其他	1,869.67	3,805.58
合计	61,803.87	860,529.13

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	160,355,922.78	-27,905,788.00
股票投资收益——赎回差价收入	29,311,314.83	-17,735,341.12
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	189,667,237.61	-45,641,129.12

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	958,886,797.64	1,654,605,924.93
减：卖出股票成本总额	798,530,874.86	1,682,511,712.93
买卖股票差价收入	160,355,922.78	-27,905,788.00

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,732,662,073.21	1,328,229,756.78
减：现金支付赎回款总额	771,517,647.21	489,909,295.78
减：赎回股票成本总额	931,833,111.17	856,055,802.12
赎回差价收入	29,311,314.83	-17,735,341.12

7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,748,877.82	37,155,232.83
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	7,748,877.82	37,155,232.83

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
1. 交易性金融资产	-19,357,437.47	74,328,269.39
股票投资	-19,357,437.47	74,328,269.39
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	-19,357,437.47	74,328,269.39

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	2,022,328.38	1,280,133.52
合计	2,022,328.38	1,280,133.52

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
交易所市场交易费用	2,286,006.94	5,520,403.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,286,006.94	5,520,403.10

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年3月19日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	-

证券出借违约金	-	-
银行费用	757.00	775.00
指数使用费	326,304.02	702,478.71
其他	150,000.00	400.00
上市费	-	70,000.00
合计	647,061.02	853,653.71

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”)	基金管理人股东
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东
山西海鑫实业有限公司(注2)	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
银华长安资本管理(北京)有限公司(注1)	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司
银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“银华 MSCI 中国 A 股 ETF 发起式联接”)	本基金的联接基金

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。

1. 根据 2020 年 10 月 24 日《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称、住所及法定代表人变更的公告》，子公司银华资本管理(珠海横琴)有限公司更名为银华长安资本管理(北京)有限公司。

2. 根据 2020 年 12 月 2 日《银华基金管理股份有限公司关于股东名称变更的公告》，股东山西海鑫实业股份有限公司更名为山西海鑫实业有限公司。

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

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,210,731.10	7,024,787.04
其中：支付销售机构的客户维护费	49,205.31	215,409.64

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	642,146.23	1,404,957.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

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自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 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
西南证券	14,584.00	0.01	14,584.00	0.00
银华MSCI中国A 股ETF发起式联 接	21,341,700.00	9.33	74,060,000.00	5.47

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 2020年1月1日至2020年12月31 日		上年度可比期间 2019年3月19日（基金合同生效日）至2019 年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,360,723.47	47,254.76	8,314,826.53	824,956.27

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(2020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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新发流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
688567	孚能科技	2020年07月08日	2021年01月18日	新发流通受限	15.9	44.06	21,422	340,609.80	943,853.32	-
688311	盟升电子	2020年07月24日	2021年2月1日	新发流通受限	41.58	115.36	4,182	173,887.56	482,435.52	-
688286	敏芯股份	2020年07月31日	2021年02月10日	新发流通受限	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688313	仕佳光子	2020年08月04日	2021年02月12日	新发流通受限	10.82	22.92	7,151	77,373.82	163,900.92	-
300912	凯龙高科	2020年11月26日	2021年06月07日	新发流通受限	17.62	28.49	5,117	90,161.54	145,783.33	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年01月14日	配股流通受限	4.59	5.46	26,039.00	119,519.01	142,172.94	-
688136	科兴制药	2020年12月03日	2021年06月14日	新发流通受限	22.33	34.59	4,032	90,034.56	139,466.88	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年01月07日	新股流通受限	74.46	74.46	1,405	104,616.30	104,616.30	-
688578	艾力斯	2020年11月23日	2021年06月02日	新发流通受限	22.73	24.79	4,100	93,193.00	101,639.00	-

300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年02月24日	新发流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300920	润阳科技	2020年12月17日	2021年06月25日	新发流通受限	26.93	34.13	2,503	67,405.79	85,427.39	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年03月29日	新发流通受限	118.27	603.36	104	12,300.08	62,749.44	-
688156	路德环境	2020年9月14日	2021年3月22日	新发流通受限	15.91	20.07	2,602	41,397.82	52,222.14	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年02月24日	新发流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年01月07日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年03月03日	新发流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新发流通受限	43.76	51.1	388	16,978.88	19,826.80	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年03月03日	新发流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年05月27日	新发流通受限	30.26	47.87	395	11,952.70	18,908.65	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年06月23日	新发流通受限	24.6	61.51	284	6,986.40	17,468.84	-
300873	海晨股份	2020年08月	2021年03月	新发流通受限	30.72	41.32	418	12,840.96	17,271.76	-

		月 14 日	月 02 日							
300898	熊猫 乳品	2020 年 10 月 09 日	2021 年 04 月 16 日	新发流 通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300868	杰美 特	2020 年 08 月 12 日	2021 年 02 月 24 日	新发流 通受限	41.26	43.28	377	15,555.02	16,316.56	-
300860	锋尚 文化	2020 年 08 月 06 日	2021 年 2 月 24 日	新发流 通受限	138.02	126.67	127	17,528.54	16,087.09	-
300909	汇创 达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 05 月 18 日	新发流 通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼 测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新发流 通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大 环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25 日	新发流 通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300884	狄耐 克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新发流 通受限	24.87	33.51	449	11,166.63	15,045.99	-
300902	国安 达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新发流 通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本 信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新发流 通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛 信息	2020 年 09 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新发流 通受限	12.65	45.3	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰 高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新发流 通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300907	康平 科技	2020 年 11	2021 年 5 月	新发流 通受限	14.3	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-

		月 11 日	18 日							
300879	大叶股份	2020 年 08 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新发流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300889	爱克股份	2020 年 09 月 09 日	2021 年 3 月 16 日	新发流通受限	27.97	30.12	392	10,964.24	11,807.04	-
300882	万胜智能	2020 年 08 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新发流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新发流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020 年 09 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新发流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新发流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新发流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新发流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新发流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

		日								
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

注：注 1：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

注 2：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10% 的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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

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；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金财产的 80%，因法律法规的规定而

受限制的情形除外。

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随时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。

本基金主要投资于上市交易的证券，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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和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 2020年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,360,723.47	-	-	-	-	-	6,360,723.47
结算备付金	639,631.24	-	-	-	-	-	639,631.24
存出保证金	90,775.27	-	-	-	-	-	90,775.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	334,392,157.85	334,392,157.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,982,340.43	1,982,340.43
应收利息	-	-	-	-	-	1,003.37	1,003.37
资产总计	7,091,129.98	-	-	-	-	336,375,501.65	343,466,631.63
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,328,409.23	5,328,409.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	147,035.00	147,035.00
应付托管费	-	-	-	-	-	29,407.00	29,407.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	216,017.59	216,017.59
其他负债	-	-	-	-	-	941,861.58	941,861.58
负债总计	-	-	-	-	-	6,662,730.40	6,662,730.40
利率敏感度缺口	7,091,129.98	-	-	-	-	329,712,771.25	336,803,901.23
上年度末 2019年12月 31日							
资产							

银行存款	8,314,826.53	-	-	-	-	-	8,314,826.53
结算备付金	241,467.36	-	-	-	-	-	241,467.36
存出保证金	155,080.36	-	-	-	-	-	155,080.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,410,107,264.72	1,410,107,264.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	367,502.35	367,502.35
应收利息	-	-	-	-	-	2,105.46	2,105.46
资产总计	8,711,374.25	-	-	-	-	1,410,476,872.53	1,419,188,246.78
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	595,371.97	595,371.97
应付托管费	-	-	-	-	-	119,074.42	119,074.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	352,460.49	352,460.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-	746,024.98	746,024.98
其他负债	-	-	-	-	-	782,478.71	782,478.71
负债总计	-	-	-	-	-	2,595,410.57	2,595,410.57
利率敏感度缺口	8,711,374.25	-	-	-	-	1,407,881,461.96	1,416,592,836.21

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	334,392,157.85	99.28	1,410,107,264.72	99.54
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	334,392,157.85	99.28	1,410,107,264.72	99.54

7.4.13.4.2.2 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%基金资产净值相应变化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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	16,728,065.88	65,854,810.76
	业绩比较基准下降 5%	-16,728,065.88	-65,854,810.76

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

本基金非以公允价值计量的金融工具，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 329,640,979.09 元，属于第二层次的余额为人民币 148,082.01 元，属于第三层次的余额为人民币 4,603,096.75 元(2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 1,407,899,419.63 元，属于第二层次的余额为人民币 2,092,475.49 元，属于第三层次的余额为人民币 115,369.60 元)。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 4,603,096.75 元；本报告期购买的属于第三层次的金额为人民币 2,083,641.24 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 2,519,455.51 元；本报告期转出第三层次的金额为人民币 137,606.16 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 22,236.56 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 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	334,392,157.85	97.36

	其中：股票	334,392,157.85	97.36
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	7,000,354.71	2.04
8	其他各项资产	2,074,119.07	0.60
9	合计	343,466,631.63	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	3,764,294.62	1.12
B	采矿业	7,356,136.10	2.18
C	制造业	189,757,710.52	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,449,418.08	1.62
E	建筑业	4,944,074.33	1.47
F	批发和零售业	4,394,363.23	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	9,153,024.63	2.72
H	住宿和餐饮业	308,355.52	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,707,488.85	3.77
J	金融业	64,022,478.85	19.01
K	房地产业	8,451,049.21	2.51
L	租赁和商务服务业	7,401,768.75	2.20
M	科学研究和技术服务业	3,814,505.54	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	184,525.65	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	429,183.21	0.13
Q	卫生和社会工作	4,948,359.62	1.47

R	文化、体育和娱乐业	1,886,927.92	0.56
S	综合	115,046.16	0.03
	合计	329,088,710.79	97.71

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,273,280.46	0.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,271.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,713.63	0.01
J	金融业	1,714,383.21	0.51
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	213,086.57	0.06
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	16,087.09	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,303,447.06	1.57

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股票投资。

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	600519	贵州茅台	10,662	21,302,676.00	6.32
2	000858	五粮液	29,386	8,576,304.10	2.55

3	601318	中国平安	80,266	6,981,536.68	2.07
4	600036	招商银行	153,434	6,743,424.30	2.00
5	600276	恒瑞医药	55,599	6,197,064.54	1.84
6	300750	宁德时代	16,896	5,932,354.56	1.76
7	601888	中国中免	19,284	5,446,765.80	1.62
8	603288	海天味业	20,254	4,061,737.16	1.21
9	601012	隆基股份	41,649	3,840,037.80	1.14
10	000001	平安银行	188,605	3,647,620.70	1.08
11	002415	海康威视	70,528	3,421,313.28	1.02
12	300760	迈瑞医疗	7,722	3,289,572.00	0.98
13	601166	兴业银行	154,623	3,226,982.01	0.96
14	600031	三一重工	91,963	3,216,865.74	0.96
15	600887	伊利股份	72,116	3,199,786.92	0.95
16	600900	长江电力	163,238	3,127,640.08	0.93
17	603259	药明康德	22,554	3,038,474.88	0.90
18	002475	立讯精密	52,931	2,970,487.72	0.88
19	600309	万华化学	30,952	2,817,870.08	0.84
20	002594	比亚迪	13,620	2,646,366.00	0.79
21	002304	洋河股份	11,136	2,627,984.64	0.78
22	002352	顺丰控股	28,661	2,528,760.03	0.75
23	000568	泸州老窖	10,773	2,436,421.68	0.72
24	600809	山西汾酒	6,481	2,432,254.49	0.72
25	300015	爱尔眼科	31,414	2,352,594.46	0.70
26	600030	中信证券	79,505	2,337,447.00	0.69
27	002714	牧原股份	28,266	2,179,308.60	0.65
28	600000	浦发银行	221,621	2,145,291.28	0.64
29	000002	万科A	73,618	2,112,836.60	0.63
30	600585	海螺水泥	40,572	2,094,326.64	0.62
31	601398	工商银行	406,563	2,028,749.37	0.60
32	300059	东方财富	65,075	2,017,325.00	0.60
33	601601	中国太保	46,517	1,786,252.80	0.53
34	601288	农业银行	561,615	1,763,471.10	0.52
35	300122	智飞生物	11,834	1,750,366.94	0.52
36	300124	汇川技术	18,181	1,696,287.30	0.50
37	002142	宁波银行	45,593	1,611,256.62	0.48
38	002027	分众传媒	160,932	1,588,398.84	0.47
39	601668	中国建筑	311,957	1,550,426.29	0.46
40	000725	京东方A	255,598	1,533,588.00	0.46
41	000661	长春高新	3,385	1,519,560.35	0.45
42	603501	韦尔股份	6,442	1,488,746.20	0.44
43	600690	海尔智家	50,687	1,480,567.27	0.44
44	600104	上汽集团	58,167	1,421,601.48	0.42

45	600048	保利地产	88,528	1,400,512.96	0.42
46	601899	紫金矿业	148,190	1,376,685.10	0.41
47	600016	民生银行	263,792	1,371,718.40	0.41
48	601100	恒立液压	12,054	1,362,102.00	0.40
49	601328	交通银行	295,924	1,325,739.52	0.39
50	600999	招商证券	55,170	1,287,667.80	0.38
51	600570	恒生电子	12,062	1,265,303.80	0.38
52	600346	恒力石化	44,410	1,242,147.70	0.37
53	600438	通威股份	32,006	1,230,310.64	0.37
54	601818	光大银行	300,029	1,197,115.71	0.36
55	600406	国电南瑞	44,380	1,179,176.60	0.35
56	002493	荣盛石化	42,476	1,172,762.36	0.35
57	002812	恩捷股份	8,252	1,169,968.56	0.35
58	600436	片仔癀	4,279	1,144,675.29	0.34
59	000538	云南白药	9,936	1,128,729.60	0.34
60	300014	亿纬锂能	13,841	1,128,041.50	0.33
61	600588	用友网络	23,941	1,050,291.67	0.31
62	600660	福耀玻璃	21,853	1,050,036.65	0.31
63	000338	潍柴动力	66,026	1,042,550.54	0.31
64	000895	双汇发展	21,844	1,025,357.36	0.30
65	600893	航发动力	17,248	1,023,668.80	0.30
66	300433	蓝思科技	32,827	1,004,834.47	0.30
67	601688	华泰证券	55,457	998,780.57	0.30
68	601211	国泰君安	56,688	993,740.64	0.30
69	000063	中兴通讯	29,205	982,748.25	0.29
70	601766	中国中车	183,526	974,523.06	0.29
71	002271	东方雨虹	25,039	971,513.20	0.29
72	300413	芒果超媒	13,370	969,325.00	0.29
73	600745	闻泰科技	9,540	944,460.00	0.28
74	600837	海通证券	73,087	939,898.82	0.28
75	002241	歌尔股份	24,856	927,625.92	0.28
76	601336	新华保险	15,895	921,433.15	0.27
77	600703	三安光电	33,650	908,886.50	0.27
78	000166	申万宏源	170,069	897,964.32	0.27
79	601919	中远海控	73,283	894,785.43	0.27
80	300347	泰格医药	5,510	890,471.10	0.26
81	600009	上海机场	11,729	887,416.14	0.26
82	000596	古井贡酒	3,224	876,928.00	0.26
83	300498	温氏股份	47,981	874,693.63	0.26
84	002050	三花智控	35,388	872,314.20	0.26
85	300601	康泰生物	4,973	867,788.50	0.26
86	601066	中信建投	20,551	863,142.00	0.26

87	600050	中国联通	191,932	856,016.72	0.25
88	002460	赣锋锂业	8,328	842,793.60	0.25
89	601229	上海银行	107,282	841,090.88	0.25
90	601988	中国银行	262,030	833,255.40	0.25
91	603993	洛阳钼业	133,148	832,175.00	0.25
92	300454	深信服	3,341	828,601.41	0.25
93	600196	复星医药	15,227	822,105.73	0.24
94	600019	宝钢股份	137,860	820,267.00	0.24
95	601901	方正证券	78,416	813,173.92	0.24
96	601138	工业富联	58,907	806,436.83	0.24
97	601628	中国人寿	20,933	803,617.87	0.24
98	601390	中国中铁	151,298	797,340.46	0.24
99	300450	先导智能	9,380	787,826.20	0.23
100	300274	阳光电源	10,700	773,396.00	0.23
101	601169	北京银行	159,252	770,779.68	0.23
102	603986	兆易创新	3,888	767,880.00	0.23
103	000768	中航西飞	20,903	766,722.04	0.23
104	600028	中国石化	190,024	765,796.72	0.23
105	002311	海大集团	11,670	764,385.00	0.23
106	601088	中国神华	41,386	745,361.86	0.22
107	002371	北方华创	4,083	737,961.42	0.22
108	000625	长安汽车	33,505	733,089.40	0.22
109	000776	广发证券	44,917	731,248.76	0.22
110	600763	通策医疗	2,644	731,118.88	0.22
111	601006	大秦铁路	112,114	724,256.44	0.22
112	000876	新希望	32,190	721,056.00	0.21
113	000100	TCL 科技	101,744	720,347.52	0.21
114	601989	中国重工	169,830	711,587.70	0.21
115	300782	卓胜微	1,243	709,181.22	0.21
116	000157	中联重科	71,199	704,870.10	0.21
117	600760	中航沈飞	8,995	703,229.10	0.21
118	600741	华域汽车	24,030	692,544.60	0.21
119	603799	华友钴业	8,696	689,592.80	0.20
120	002230	科大讯飞	16,852	688,741.24	0.20
121	601186	中国铁建	86,978	687,126.20	0.20
122	601857	中国石油	162,956	676,267.40	0.20
123	002410	广联达	8,577	675,352.98	0.20
124	600926	杭州银行	44,400	662,448.00	0.20
125	001979	招商蛇口	49,820	662,107.80	0.20
126	002179	中航光电	8,391	656,931.39	0.20
127	601633	长城汽车	17,100	646,551.00	0.19
128	600547	山东黄金	27,345	645,888.90	0.19

129	601877	正泰电器	16,387	641,714.92	0.19
130	603882	金城医学	4,983	638,421.96	0.19
131	603899	晨光文具	6,997	619,654.32	0.18
132	600919	江苏银行	113,235	618,263.10	0.18
133	002821	凯莱英	2,048	612,638.72	0.18
134	601009	南京银行	75,299	608,415.92	0.18
135	600015	华夏银行	96,568	603,550.00	0.18
136	601155	新城控股	17,301	602,593.83	0.18
137	603160	汇顶科技	3,783	588,445.65	0.17
138	002129	中环股份	23,017	586,933.50	0.17
139	601225	陕西煤业	62,817	586,710.78	0.17
140	002007	华兰生物	13,705	578,899.20	0.17
141	002049	紫光国微	4,309	576,587.29	0.17
142	600872	中炬高新	8,433	562,059.45	0.17
143	002841	视源股份	4,828	555,364.84	0.16
144	002001	新和成	16,377	551,577.36	0.16
145	603369	今世缘	9,562	548,667.56	0.16
146	601788	光大证券	29,577	547,766.04	0.16
147	002024	苏宁易购	70,161	540,941.31	0.16
148	002600	领益智造	44,466	533,147.34	0.16
149	600958	东方证券	45,277	526,571.51	0.16
150	601360	三六零	33,408	524,839.68	0.16
151	600176	中国巨石	26,263	524,209.48	0.16
152	601933	永辉超市	71,933	516,478.94	0.15
153	600600	青岛啤酒	5,174	514,295.60	0.15
154	000786	北新建材	12,577	503,708.85	0.15
155	002555	三七互娱	16,100	502,803.00	0.15
156	603338	浙江鼎力	4,958	501,700.02	0.15
157	600183	生益科技	17,512	493,137.92	0.15
158	002414	高德红外	11,764	491,147.00	0.15
159	601816	京沪高铁	86,634	490,348.44	0.15
160	300677	英科医疗	2,900	487,635.00	0.14
161	300408	三环集团	13,046	485,963.50	0.14
162	300285	国瓷材料	10,768	485,744.48	0.14
163	601985	中国核电	97,466	479,532.72	0.14
164	600132	重庆啤酒	3,989	474,651.11	0.14
165	601799	星宇股份	2,305	462,152.50	0.14
166	300033	同花顺	3,715	460,585.70	0.14
167	600383	金地集团	33,953	458,365.50	0.14
168	601939	建设银行	72,523	455,444.44	0.14
169	002236	大华股份	22,777	453,034.53	0.13
170	603659	璞泰来	4,017	451,470.63	0.13

171	600426	华鲁恒升	12,063	449,949.90	0.13
172	601669	中国电建	115,609	448,562.92	0.13
173	002568	百润股份	4,300	448,447.00	0.13
174	600886	国投电力	51,323	443,430.72	0.13
175	603833	欧派家居	3,289	442,370.50	0.13
176	000938	紫光股份	21,599	441,699.55	0.13
177	300142	沃森生物	11,397	439,468.32	0.13
178	600845	宝信软件	6,366	439,126.68	0.13
179	601377	兴业证券	50,583	439,060.44	0.13
180	000069	华侨城 A	61,714	437,552.26	0.13
181	002916	深南电路	4,030	435,481.80	0.13
182	002624	完美世界	14,684	433,178.00	0.13
183	002736	国信证券	31,749	433,056.36	0.13
184	600298	安琪酵母	8,463	432,205.41	0.13
185	300676	华大基因	3,350	430,676.00	0.13
186	002607	中公教育	12,217	429,183.21	0.13
187	603939	益丰药房	4,724	426,057.56	0.13
188	600885	宏发股份	7,795	422,644.90	0.13
189	000799	酒鬼酒	2,700	422,550.00	0.13
190	000066	中国长城	22,219	421,938.81	0.13
191	601878	浙商证券	27,131	415,104.30	0.12
192	600029	南方航空	69,383	413,522.68	0.12
193	300496	中科创达	3,525	412,425.00	0.12
194	300628	亿联网络	5,558	406,400.96	0.12
195	600161	天坛生物	9,661	402,863.70	0.12
196	600010	包钢股份	343,648	402,068.16	0.12
197	300529	健帆生物	5,928	402,036.96	0.12
198	601881	中国银河	32,089	401,433.39	0.12
199	002602	世纪华通	56,203	399,603.33	0.12
200	601658	邮储银行	83,168	397,543.04	0.12
201	000860	顺鑫农业	5,467	396,576.18	0.12
202	002709	天赐材料	3,800	394,440.00	0.12
203	603737	三棵树	2,599	393,748.50	0.12
204	300724	捷佳伟创	2,700	393,120.00	0.12
205	603806	福斯特	4,600	392,840.00	0.12
206	002791	坚朗五金	2,700	388,800.00	0.12
207	002601	龙蟠佰利	12,607	387,917.39	0.12
208	002074	国轩高科	9,894	387,053.28	0.11
209	603345	安井食品	2,000	385,740.00	0.11
210	300308	中际旭创	7,535	383,230.10	0.11
211	600340	华夏幸福	29,632	383,141.76	0.11
212	002508	老板电器	9,339	380,844.42	0.11

213	601021	春秋航空	6,869	380,748.67	0.11
214	300699	光威复材	4,251	378,551.55	0.11
215	601111	中国国航	50,121	375,406.29	0.11
216	603233	大参林	4,789	375,218.15	0.11
217	600109	国金证券	22,952	373,429.04	0.11
218	601618	中国中冶	134,772	367,927.56	0.11
219	002202	金风科技	25,807	367,749.75	0.11
220	002625	光启技术	16,500	367,125.00	0.11
221	600061	国投资本	26,438	365,637.54	0.11
222	300003	乐普医疗	13,380	363,668.40	0.11
223	603605	珀莱雅	2,034	362,052.00	0.11
224	600521	华海药业	10,686	361,293.66	0.11
225	300558	贝达药业	3,364	361,192.68	0.11
226	600699	均胜电子	14,220	360,619.20	0.11
227	603019	中科曙光	10,477	358,627.71	0.11
228	601600	中国铝业	98,666	358,157.58	0.11
229	600111	北方稀土	27,286	357,173.74	0.11
230	600079	人福医药	10,500	355,740.00	0.11
231	000703	恒逸石化	27,761	355,340.80	0.11
232	300207	欣旺达	11,569	355,283.99	0.11
233	600606	绿地控股	60,933	355,239.39	0.11
234	300595	欧普康视	4,310	353,075.20	0.10
235	000783	长江证券	41,646	349,826.40	0.10
236	000963	华东医药	13,137	348,918.72	0.10
237	300144	宋城演艺	19,629	347,825.88	0.10
238	603658	安图生物	2,388	346,689.84	0.10
239	300012	华测检测	12,618	345,354.66	0.10
240	300037	新宙邦	3,400	344,760.00	0.10
241	002120	韵达股份	21,939	344,442.30	0.10
242	601916	浙商银行	84,000	342,720.00	0.10
243	601108	财通证券	27,007	341,638.55	0.10
244	601966	玲珑轮胎	9,701	341,184.17	0.10
245	601990	南京证券	27,717	340,087.59	0.10
246	300661	圣邦股份	1,289	340,038.20	0.10
247	600352	浙江龙盛	24,926	339,492.12	0.10
248	002353	杰瑞股份	9,696	339,360.00	0.10
249	600486	扬农化工	2,562	338,184.00	0.10
250	002013	中航机电	29,376	336,355.20	0.10
251	002044	美年健康	29,634	335,753.22	0.10
252	603517	绝味食品	4,324	335,282.96	0.10
253	600779	水井坊	4,024	334,072.48	0.10
254	600674	川投能源	32,987	331,519.35	0.10

255	002384	东山精密	12,733	331,058.00	0.10
256	002459	晶澳科技	8,100	329,832.00	0.10
257	600115	东方航空	70,456	329,734.08	0.10
258	601727	上海电气	60,988	329,335.20	0.10
259	600143	金发科技	19,200	329,088.00	0.10
260	000547	航天发展	11,883	326,782.50	0.10
261	600489	中金黄金	36,646	322,851.26	0.10
262	600536	中国软件	4,070	320,553.20	0.10
263	600018	上港集团	69,868	319,296.76	0.09
264	000425	徐工机械	59,308	318,483.96	0.09
265	002157	正邦科技	18,688	318,443.52	0.09
266	603816	顾家家居	4,500	317,295.00	0.09
267	600362	江西铜业	15,818	315,569.10	0.09
268	601216	君正集团	63,714	315,384.30	0.09
269	600004	白云机场	22,217	313,926.21	0.09
270	002252	上海莱士	42,415	313,871.00	0.09
271	002797	第一创业	31,231	310,748.45	0.09
272	601689	拓普集团	8,041	309,015.63	0.09
273	600754	锦江酒店	5,984	308,355.52	0.09
274	601162	天风证券	50,408	307,488.80	0.09
275	002557	洽洽食品	5,662	304,898.70	0.09
276	002080	中材科技	12,500	302,250.00	0.09
277	300316	晶盛机电	9,990	300,499.20	0.09
278	600332	白云山	10,268	300,339.00	0.09
279	002385	大北农	30,977	299,237.82	0.09
280	603638	艾迪精密	4,300	296,442.00	0.09
281	002032	苏泊尔	3,799	296,284.01	0.09
282	600705	中航资本	67,452	295,439.76	0.09
283	601319	中国人保	44,894	294,953.58	0.09
284	000728	国元证券	32,747	293,413.12	0.09
285	600118	中国卫星	9,113	293,256.34	0.09
286	603589	口子窖	4,250	292,825.00	0.09
287	300223	北京君正	3,200	292,768.00	0.09
288	601555	东吴证券	29,377	289,657.22	0.09
289	601838	成都银行	27,107	289,231.69	0.09
290	601872	招商轮船	50,973	287,997.45	0.09
291	601233	桐昆股份	13,962	287,477.58	0.09
292	600066	宇通客车	16,975	287,217.00	0.09
293	000977	浪潮信息	10,670	286,809.60	0.09
294	300253	卫宁健康	16,264	284,620.00	0.08
295	000656	金科股份	40,099	284,301.91	0.08
296	600089	特变电工	27,983	284,027.45	0.08

297	300146	汤臣倍健	11,684	282,168.60	0.08
298	600201	生物股份	13,465	281,283.85	0.08
299	002185	华天科技	20,584	280,354.08	0.08
300	600219	南山铝业	88,681	280,231.96	0.08
301	601607	上海医药	14,557	279,494.40	0.08
302	002078	太阳纸业	19,352	279,249.36	0.08
303	600233	圆通速递	24,100	277,150.00	0.08
304	601198	东兴证券	20,774	276,709.68	0.08
305	300357	我武生物	3,594	275,659.80	0.08
306	600739	辽宁成大	11,331	275,569.92	0.08
307	000800	一汽解放	23,400	273,312.00	0.08
308	600511	国药股份	5,477	270,070.87	0.08
309	000050	深天马 A	18,297	269,697.78	0.08
310	300251	光线传媒	22,260	268,678.20	0.08
311	002456	欧菲光	20,239	266,750.02	0.08
312	002690	美亚光电	6,023	266,698.44	0.08
313	002673	西部证券	26,191	265,576.74	0.08
314	600038	中直股份	4,160	260,873.60	0.08
315	002156	通富微电	10,303	260,047.72	0.08
316	300136	信维通信	7,239	259,735.32	0.08
317	002773	康弘药业	5,363	258,228.45	0.08
318	600998	九州通	14,212	258,089.92	0.08
319	601800	中国交建	35,435	257,258.10	0.08
320	601456	国联证券	12,000	255,960.00	0.08
321	002299	圣农发展	9,584	254,359.36	0.08
322	600522	中天科技	23,370	253,330.80	0.08
323	600598	北大荒	13,149	253,118.25	0.08
324	002340	格林美	36,167	252,807.33	0.08
325	600460	士兰微	10,101	252,525.00	0.07
326	000961	中南建设	28,508	251,725.64	0.07
327	300482	万孚生物	2,812	250,858.52	0.07
328	002127	南极电商	18,272	249,960.96	0.07
329	002507	涪陵榨菜	5,876	248,554.80	0.07
330	600011	华能国际	55,235	247,452.80	0.07
331	600177	雅戈尔	34,382	247,206.58	0.07
332	002926	华西证券	19,708	245,955.84	0.07
333	002925	盈趣科技	3,792	243,939.36	0.07
334	002463	沪电股份	12,943	243,198.97	0.07
335	002500	山西证券	26,961	241,300.95	0.07
336	000750	国海证券	40,898	239,662.28	0.07
337	603712	七一二	5,727	238,529.55	0.07
338	002603	以岭药业	9,275	236,512.50	0.07

339	603444	吉比特	548	233,448.00	0.07
340	600068	葛洲坝	34,727	228,503.66	0.07
341	600637	东方明珠	25,525	228,193.50	0.07
342	002030	达安基因	6,586	225,899.80	0.07
343	002294	信立泰	7,973	225,875.09	0.07
344	603866	桃李面包	3,813	225,348.30	0.07
345	002373	千方科技	11,676	223,245.12	0.07
346	600988	赤峰黄金	12,400	222,084.00	0.07
347	600655	豫园股份	24,729	219,840.81	0.07
348	601117	中国化学	37,399	219,532.13	0.07
349	000932	华菱钢铁	45,916	219,478.48	0.07
350	002558	巨人网络	12,558	218,885.94	0.06
351	600801	华新水泥	10,593	218,533.59	0.06
352	600909	华安证券	27,182	217,456.00	0.06
353	002372	伟星新材	11,603	216,976.10	0.06
354	002180	纳思达	8,105	216,646.65	0.06
355	002223	鱼跃医疗	7,641	215,552.61	0.06
356	603883	老百姓	3,415	214,564.45	0.06
357	600372	中航电子	10,886	213,909.90	0.06
358	002958	青农商行	41,844	212,985.96	0.06
359	600498	烽火通信	8,825	212,506.00	0.06
360	002146	荣盛发展	32,542	212,499.26	0.06
361	002511	中顺洁柔	10,176	212,373.12	0.06
362	002405	四维图新	14,851	211,923.77	0.06
363	000739	普洛药业	9,083	211,452.24	0.06
364	002429	兆驰股份	34,000	210,800.00	0.06
365	600529	山东药玻	4,200	210,630.00	0.06
366	600875	东方电气	20,953	208,901.41	0.06
367	002151	北斗星通	4,100	208,731.00	0.06
368	002153	石基信息	6,701	208,334.09	0.06
369	000723	美锦能源	31,145	208,048.60	0.06
370	601099	太平洋	50,954	207,892.32	0.06
371	600867	通化东宝	15,503	207,430.14	0.06
372	002439	启明星辰	7,082	206,865.22	0.06
373	601231	环旭电子	10,682	206,589.88	0.06
374	600848	上海临港	10,300	206,206.00	0.06
375	000021	深科技	10,829	205,859.29	0.06
376	002422	科伦药业	10,559	205,266.96	0.06
377	600380	健康元	14,744	205,089.04	0.06
378	000630	铜陵有色	79,633	204,656.81	0.06
379	600516	方大炭素	28,809	203,679.63	0.06
380	603707	健友股份	5,782	203,121.66	0.06

381	603858	步长制药	8,801	203,039.07	0.06
382	002939	长城证券	15,769	202,947.03	0.06
383	000671	阳光城	31,109	202,830.68	0.06
384	000998	隆平高科	10,238	202,814.78	0.06
385	002705	新宝股份	4,800	202,800.00	0.06
386	000738	航发控制	8,832	202,517.76	0.06
387	600208	新潮中宝	65,044	201,636.40	0.06
388	601077	渝农商行	44,700	201,150.00	0.06
389	000987	越秀金控	13,800	200,928.00	0.06
390	002683	宏大爆破	5,539	199,127.05	0.06
391	600170	上海建工	65,834	198,160.34	0.06
392	002065	东华软件	23,746	197,091.80	0.06
393	600487	亨通光电	13,984	195,636.16	0.06
394	300383	光环新网	11,362	195,085.54	0.06
395	600642	申能股份	37,239	194,387.58	0.06
396	600895	张江高科	11,394	194,153.76	0.06
397	002465	海格通信	17,689	191,571.87	0.06
398	002152	广电运通	17,878	190,937.04	0.06
399	002081	金螳螂	20,153	189,236.67	0.06
400	002212	天融信	8,983	188,732.83	0.06
401	601992	金隅集团	62,881	186,756.57	0.06
402	000999	华润三九	7,461	186,077.34	0.06
403	600859	王府井	5,700	185,706.00	0.06
404	002075	沙钢股份	16,920	185,612.40	0.06
405	600188	兖州煤业	18,374	185,026.18	0.05
406	300070	碧水源	24,121	184,525.65	0.05
407	000027	深圳能源	30,117	183,412.53	0.05
408	000513	丽珠集团	4,507	182,533.50	0.05
409	000423	东阿阿胶	4,714	182,478.94	0.05
410	000627	天茂集团	37,457	182,415.59	0.05
411	002242	九阳股份	5,685	182,147.40	0.05
412	300463	迈克生物	3,900	181,740.00	0.05
413	000729	燕京啤酒	21,283	181,331.16	0.05
414	000975	银泰黄金	20,964	180,500.04	0.05
415	300418	昆仑万维	9,037	180,288.15	0.05
416	002019	亿帆医药	9,511	180,043.23	0.05
417	000709	河钢股份	80,335	179,950.40	0.05
418	603027	千禾味业	4,800	179,424.00	0.05
419	000988	华工科技	7,664	177,728.16	0.05
420	300773	拉卡拉	5,900	176,528.00	0.05
421	600153	建发股份	21,410	175,776.10	0.05
422	000983	山西焦煤	31,124	175,539.36	0.05

423	600027	华电国际	51,339	174,552.60	0.05
424	001914	招商积余	8,082	174,005.46	0.05
425	600026	中远海能	25,923	173,165.64	0.05
426	600549	厦门钨业	10,269	173,032.65	0.05
427	002563	森马服饰	17,240	172,744.80	0.05
428	601598	中国外运	38,649	170,055.60	0.05
429	000686	东北证券	17,290	169,787.80	0.05
430	600315	上海家化	4,862	168,857.26	0.05
431	600704	物产中大	38,484	168,175.08	0.05
432	002572	索菲亚	6,476	167,728.40	0.05
433	000540	中天金融	52,394	165,041.10	0.05
434	600160	巨化股份	20,274	164,422.14	0.05
435	002506	协鑫集成	38,634	164,194.50	0.05
436	300088	长信科技	18,146	161,317.94	0.05
437	601098	中南传媒	16,618	158,369.54	0.05
438	600688	上海石化	45,750	157,380.00	0.05
439	000825	太钢不锈	43,017	155,291.37	0.05
440	002131	利欧股份	51,085	154,787.55	0.05
441	002216	三全食品	5,900	153,105.00	0.05
442	600879	航天电子	20,426	152,786.48	0.05
443	601128	常熟银行	20,627	152,227.26	0.05
444	600667	太极实业	16,053	151,700.85	0.05
445	600967	内蒙一机	12,404	150,832.64	0.04
446	600583	海油工程	33,200	149,068.00	0.04
447	000401	冀东水泥	10,471	148,164.65	0.04
448	000623	吉林敖东	8,965	147,653.55	0.04
449	601699	潞安环能	22,700	147,550.00	0.04
450	000402	金融街	22,682	146,298.90	0.04
451	600256	广汇能源	51,415	145,504.45	0.04
452	000581	威孚高科	6,237	144,636.03	0.04
453	300212	易华录	4,680	143,442.00	0.04
454	300271	华宇软件	6,007	143,387.09	0.04
455	600977	中国电影	11,455	142,729.30	0.04
456	002281	光迅科技	4,912	142,644.48	0.04
457	300376	易事特	17,800	141,688.00	0.04
458	300024	机器人	11,493	141,363.90	0.04
459	000629	攀钢钒钛	64,971	140,987.07	0.04
460	000028	国药一致	3,045	139,461.00	0.04
461	600021	上海电力	19,565	139,302.80	0.04
462	002399	海普瑞	7,922	136,416.84	0.04
463	600566	济川药业	6,670	134,934.10	0.04
464	600167	联美控股	11,294	128,186.90	0.04

465	000089	深圳机场	15,631	127,705.27	0.04
466	300017	网宿科技	18,193	125,349.77	0.04
467	002387	维信诺	10,624	121,113.60	0.04
468	300296	利亚德	18,982	120,725.52	0.04
469	002010	传化智联	24,765	116,643.15	0.03
470	600673	东阳光	22,872	115,046.16	0.03
471	002468	申通快递	11,340	114,307.20	0.03
472	000046	泛海控股	32,404	106,285.12	0.03
473	300026	红日药业	22,798	104,414.84	0.03

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

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	601995	中金公司	24,951.00	1,714,383.21	0.51
2	688567	孚能科技	21,422.00	943,853.32	0.28
3	688311	盟升电子	4,182.00	482,435.52	0.14
4	688063	派能科技	1,804.00	466,550.48	0.14
5	688286	敏芯股份	1,681.00	197,231.73	0.06
6	688313	仕佳光子	7,151.00	163,900.92	0.05
7	300912	凯龙高科	5,117.00	145,783.33	0.04
8	688136	科兴制药	4,032.00	139,466.88	0.04
9	688617	惠泰医疗	1,405.00	104,616.30	0.03
10	688578	艾力斯	4,100.00	101,639.00	0.03
11	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
12	300920	润阳科技	2,503.00	85,427.39	0.03
13	300896	爱美客	104	62,749.44	0.02
14	688156	路德环境	2,602.00	52,222.14	0.02
15	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
16	300927	江天化学	2,163.00	28,962.57	0.01
17	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
18	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
19	300861	美畅股份	388	19,826.80	0.01
20	300878	维康药业	401	19,536.72	0.01
21	300910	瑞丰新材	395	18,908.65	0.01
22	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
23	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
24	300919	中伟股份	284	17,468.84	0.01
25	300873	海晨股份	418	17,271.76	0.01
26	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
27	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
28	300868	杰美特	377	16,316.56	0.00
29	300860	锋尚文化	127	16,087.09	0.00

30	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
31	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
32	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
33	300884	狄耐克	449	15,045.99	0.00
34	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
35	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
36	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
37	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
38	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
39	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
40	300889	爱克股份	392	11,807.04	0.00
41	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
42	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
43	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
44	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
45	300918	南山智尚	1,063.00	9,503.22	0.00
46	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
47	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
48	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
49	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
50	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

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	000858	五粮液	11,378,085.50	0.80
2	300760	迈瑞医疗	7,606,028.64	0.54
3	000001	平安银行	7,139,242.40	0.50
4	600276	恒瑞医药	6,700,305.56	0.47
5	300750	宁德时代	6,481,205.00	0.46
6	002714	牧原股份	6,454,910.60	0.46
7	002415	海康威视	5,822,597.81	0.41
8	002475	立讯精密	5,638,959.12	0.40
9	002304	洋河股份	5,615,757.81	0.40
10	600519	贵州茅台	5,258,383.77	0.37
11	000651	格力电器	5,257,466.56	0.37
12	002352	顺丰控股	5,166,376.10	0.36
13	601318	中国平安	5,010,179.52	0.35
14	000568	泸州老窖	5,005,689.60	0.35
15	600036	招商银行	4,974,364.00	0.35
16	000002	万科 A	4,889,859.00	0.35
17	300122	智飞生物	4,085,878.00	0.29

18	300015	爱尔眼科	3,720,931.30	0.26
19	000063	中兴通讯	3,502,169.70	0.25
20	600745	闻泰科技	3,492,367.00	0.25

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 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	000858	五粮液	36,618,536.44	2.58
2	300750	宁德时代	21,732,280.42	1.53
3	600519	贵州茅台	20,015,445.77	1.41
4	002415	海康威视	19,280,756.45	1.36
5	002475	立讯精密	17,512,491.67	1.24
6	000001	平安银行	16,561,217.04	1.17
7	000002	万科 A	16,285,016.98	1.15
8	002714	牧原股份	14,649,372.66	1.03
9	000651	格力电器	14,212,279.48	1.00
10	002304	洋河股份	12,596,775.43	0.89
11	300760	迈瑞医疗	11,950,360.62	0.84
12	000568	泸州老窖	10,728,897.91	0.76
13	300015	爱尔眼科	10,160,707.46	0.72
14	300498	温氏股份	9,818,294.21	0.69
15	000725	京东方 A	9,610,995.52	0.68
16	002142	宁波银行	9,282,533.15	0.66
17	000333	美的集团	9,104,686.52	0.64
18	000063	中兴通讯	9,066,212.55	0.64
19	300059	东方财富	8,511,004.40	0.60
20	300122	智飞生物	8,466,957.56	0.60

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	479,071,555.30
卖出股票收入（成交）总额	958,886,797.64

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	90,775.27
2	应收证券清算款	1,982,340.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,003.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,074,119.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601995	中金公司	1,714,383.21	0.51	新发流通受限
2	688567	孚能科技	943,853.32	0.28	新发流通受限
3	688311	盟升电子	482,435.52	0.14	新发流通受限
4	688286	敏芯股份	197,231.73	0.06	新发流通受限

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，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
2,236	102,328.08	140,378,092.00	61.35	88,427,490.00	38.65

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 (%)
其中：中国工商银行股份有限公司—银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	21,341,700.00	9.33

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	国开金融有限责任公司	46,440,000.00	20.30
2	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	45,235,600.00	19.77
3	中信建投证券股份有限公司	6,097,302.00	2.66
4	招商证券股份有限公司	4,953,789.00	2.17

	司		
5	友邦人寿保险有限公司—传统—普通保险产品	4,683,400.00	2.05
6	友邦人寿保险有限公司—传统—普通保险产品	4,682,400.00	2.05
7	张晓川	2,880,000.00	1.26
8	广发证券股份有限公司	2,664,435.00	1.16
9	詹菊香	2,560,000.00	1.12
10	赵汝佳	2,360,000.00	1.03
11	中国工商银行股份有限公司—银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	21,341,700.00	9.33

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（2019年3月19日） 基金份额总额	2,058,805,582.00
本报告期期初基金份额总额	1,353,805,582.00
本报告期基金总申购份额	414,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,539,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	228,805,582.00

§ 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产以及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德勤华永会计师事务所（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 50,000.00 元。该审计机构连续两年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长江证券股份有限公司	2	828,902,265.60	58.33%	606,183.88	52.67%	-
广发证券股份有限公司	2	4,730,854.33	0.33%	3,459.59	0.30%	-
国盛证券有限责任公司	2	29,632,468.92	2.09%	21,669.50	1.88%	-
中泰证券股	4	301,121,366.97	21.19%	280,438.82	24.37%	新增 1

份有限公司						个交易单元
兴业证券股份有限公司	1	256,775,479.62	18.07%	239,136.96	20.78%	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个交 易单 元
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
野村东方国 际证券有限 公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交 易单 元
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
天风证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 2 个交易单元
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

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

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2020 年 1 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-15
2	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2020 年 1 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-15
3	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金调整申购与赎回程序并修改基金合同和托管协议相关条款的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-15
4	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-15
5	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-15
6	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-17
7	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-17
8	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2020 年 1 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-17
9	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2020 年 1 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-17
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金参与转融证券出借业务并相应修改基金合同的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-17
11	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020-01-18
12	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-01-18
13	《银华基金管理股份有限公司关于增加兴业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》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-02-25

14	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
15	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
16	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 3 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
17	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 3 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
18	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加扩位证券简称的公告》	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
19	《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
20	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金投资关联方承销证券的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-19
21	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-03-24
22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020-04-18
23	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-04-18
24	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020-04-22
25	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-04-22
26	《银华基金管理股份有限公司关于增加东吴证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-06-18
27	《银华基金管理股份有限公司关于增	中国证券报、证券时报、	2020-07-03

	加中信证券华南股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	
28	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020-07-18
29	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-07-18
30	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2020-08-28
31	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-08-28
32	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-09-01
33	《银华基金管理股份有限公司关于旗下上海证券交易所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-09-21
34	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-10-16
35	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020-10-27
36	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-10-27
37	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-12-25
38	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 5 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020-12-25

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	2020/12/30-2020/12/31	46,440,000.00	0.00	0.00	46,440,000.00	20.30
	2	2020/01/10-2020/02/16	256,766,062.00	0.00	256,766,062.00	0.00	0.00
	3	2020/07/20-2020/07/20	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	3	2020/07/22-2020/07/23	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	3	2020/07/27-2020/07/28	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	3	2020/07/30-2020/08/20	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	3	2020/08/24-2020/09/06	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	3	2020/11/11-2020/12/28	97,465,857.00	0.00	97,465,857.00	0.00	0.00
	4	2020/01/01-2020/07/14	344,677,019.00	0.00	344,677,019.00	0.00	0.00

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

本基金管理人于 2020 年 3 月 19 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华 MSCI 中国 A 股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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.4 《银华 MSCI 中国 A 股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 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

13.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

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。

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

2021 年 3 月 29 日