

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证
券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4 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	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪港深
场内简称	沪港深（扩位证券简称：沪港深 500ETF）
基金主代码	517000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	657,793,000.00 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	2021 年 3 月 5 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>本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。</p> <p>建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。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资产的 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	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	<p>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、货币市场基金。</p> <p>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。本基金还可投资港股通投资标的的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	银华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张姗
	联系电话	(010)58163000	0755-83077987
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	95555	
传真	(010)58163027	0755-83195201	
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	100738	518040	
法定代表人	王珠林	缪建民	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-16,770,524.63
本期利润	2,495,827.38
加权平均基金份额本期利润	0.0037
本期加权平均净值利润率	0.49%
本期基金份额净值增长率	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-168,704,885.49
期末可供分配基金份额利润	-0.2565
期末基金资产净值	489,088,114.51
期末基金份额净值	0.7435
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.65%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

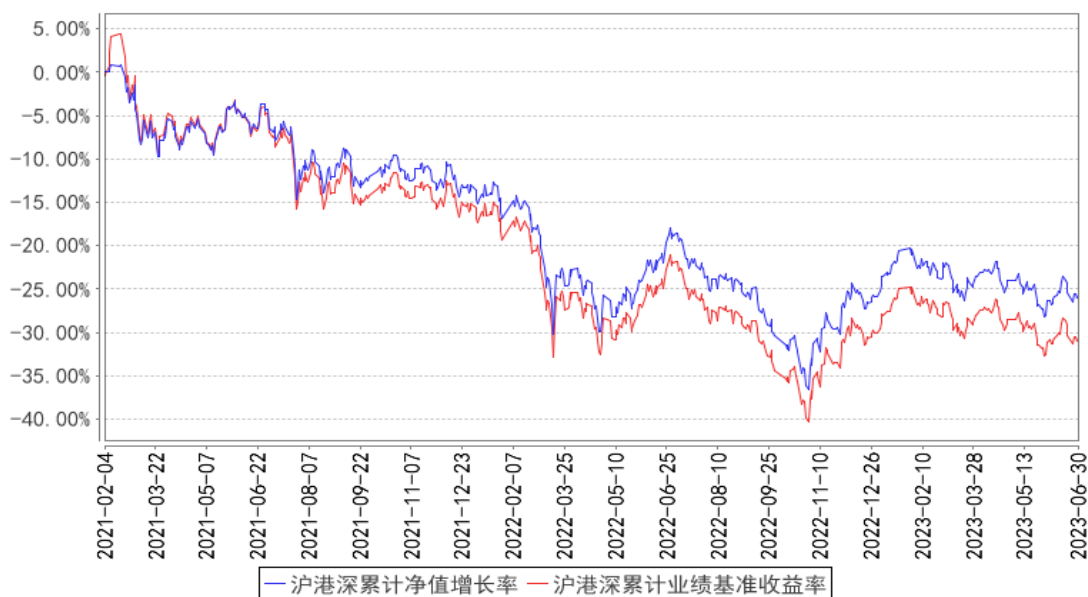
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.59%	0.92%	3.09%	0.93%	0.50%	-0.01%
过去三个月	-2.77%	0.85%	-3.68%	0.87%	0.91%	-0.02%
过去六个月	0.27%	0.87%	-0.90%	0.88%	1.17%	-0.01%
过去一年	-8.72%	1.06%	-11.31%	1.08%	2.59%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-25.65%	1.15%	-30.62%	1.20%	4.97%	-0.05%

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

沪港深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资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 188 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 指数证券投资基金(LOF)、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证券投资基金(QDII-LOF)、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 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、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 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、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、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、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华全球新能源车

量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金。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		
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	10.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 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基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银

				<p>华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日至 2023 年 4 月 12 日兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 6 月 20 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 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 20 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 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 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基金经理，自 2021 年 10 月 26 日至 2023 年 4 月 6 日兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 7 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 30 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 18 日至 2023 年 3 月 17 日兼任银华中证消费电子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 30 日起兼任银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资</p>
--	--	--	--	---

					资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日起兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 26 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
李宜璇女士	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	9 年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014 年 12 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 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 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 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 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起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基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 29 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 2021 年 5 月 25 日起兼任银华中证港股通消费主题交易

					型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 10 月 26 日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 1 月 17 日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 4 月 7 日起兼任银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金(QDII)基金经理,自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。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	2021 年 4 月 19 日	-	9 年	学士学位。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,历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员,现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合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 5 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

2023 年上半年，经济运行经历了一次从脉冲上行到缓慢回落的过程。首先，年初的春节效应叠加疫情政策优化，使一季度经济呈现脉冲式反弹，客流、消费都迎来了大幅度同比上升；而进入四月后，伴随着上述两大效应进入尾声，外需偏弱、地产投资向下等经济周期性因素逐步显现，经济运行从高位开始逐步回落。海外方面，美联储以加息压制通胀的过程仍在持续，这种弱外需状态在全球各个出口型经济体数据上都有体现。在上述因素的作用下，A 股和港股市场主要指数在上半年呈现冲高回落，明显分化的状态。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7435 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.27%，业绩比较基准收益率为-0.90%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，经济的运行自有其内在规律，上半年的经济整体运行状态，包括脉冲回落与行业分化，都是后疫情时代的正常现象，是经济自身周期的体现。我们仍然认为，从经济场景的恢复，到经济活动的扩展，再到收入水平的提升，都将是一个缓慢但可持续的过程。未来一段时期，国内政策、外需出口、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 and 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	24,211,042.02	28,414,618.75
结算备付金		11,513.19	13,878.30
存出保证金		87,043.97	11,972.36
交易性金融资产	6.4.7.2	463,899,637.96	489,464,640.56
其中：股票投资		463,899,637.96	489,464,640.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		308,602.91	-
应收股利		1,063,528.73	17,381.66
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		489,581,368.78	517,922,491.63
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		40.68	43.46
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		200,889.42	221,563.95
应付托管费		40,177.88	44,312.79
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	252,146.29	277,423.60
负债合计		493,254.27	543,343.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	657,793,000.00	697,793,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-168,704,885.49	-180,413,852.17
净资产合计		489,088,114.51	517,379,147.83
负债和净资产总计		489,581,368.78	517,922,491.63

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7435 元，基金份额总额 657,793,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,139,708.43	-46,763,903.75
1. 利息收入		50,774.53	60,716.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	50,774.53	60,716.19
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,260,860.50	-29,237,554.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-21,157,948.86	-35,840,860.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	14,210.52
股利收益	6.4.7.19	5,897,088.36	6,589,095.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	19,266,352.01	-17,744,068.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	83,442.39	157,003.76
减：二、营业总支出		1,643,881.05	2,004,016.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,271,495.70	1,569,656.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	254,299.05	313,931.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	51.18
8. 其他费用	6.4.7.23	118,086.30	120,377.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,495,827.38	-48,767,920.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,495,827.38	-48,767,920.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,495,827.38	-48,767,920.60

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	697,793,000.00	-	-180,413,852.17	517,379,147.83

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	697,793,000.00	-	-180,413,852.17	517,379,147.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-40,000,000.00	-	11,708,966.68	-28,291,033.32
(一)、综合收益总额	-	-	2,495,827.38	2,495,827.38
(二)、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)	-40,000,000.00	-	9,213,139.30	-30,786,860.70
其中：1. 基金申购款	15,000,000.00	-	-3,444,619.32	11,555,380.68
2. 基金赎回款	-55,000,000.00	-	12,657,758.62	-42,342,241.38
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	657,793,000.00	-	-168,704,885.49	489,088,114.51
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	842,793,000.00	-	-110,001,319.60	732,791,680.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	842,793,000.00	-	-110,001,319.60	732,791,680.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,000,000.00	-	-29,612,377.86	-119,612,377.86
(一)、综合收益总额	-	-	-48,767,920.60	-48,767,920.60
(二)、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)	-90,000,000.00	-	19,155,542.74	-70,844,457.26
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	-	-6,205,992.65	23,794,007.35
2. 基金赎回款	-120,000,000.00	-	25,361,535.39	-94,638,464.61
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	752,793,000.00	-	-139,613,697.46	613,179,302.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督

管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3526号《关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,482,793,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0165 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,482,793,000.00 份基金份额,未发生利息折份额的情况。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管通知书[2021]76 号核准,本基金 1,482,793,000.00 份基金份额于 2021 年 3 月 5 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。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资产的 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、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、港股通标的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、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、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为:中证沪港深 500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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》、本基金基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	24,211,042.02
等于：本金	24,208,374.11
加：应计利息	2,667.91
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	
其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	24,211,042.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	609,055,513.93	-	463,899,637.96	-145,155,875.97
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	609,055,513.93	-	463,899,637.96	-145,155,875.97

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,050.35
其中：交易所市场	43,050.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
合计	252,146.29

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	697,793,000.00	697,793,000.00
本期申购	15,000,000.00	15,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-55,000,000.00	-55,000,000.00
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	657,793,000.00	657,793,000.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-79,609,970.29	-100,803,881.88	-180,413,852.17
本期利润	-16,770,524.63	19,266,352.01	2,495,827.38
本期基金份额交易产生的变动数	4,962,450.24	4,250,689.06	9,213,139.30
其中：基金申购款	-1,883,288.05	-1,561,331.27	-3,444,619.32
基金赎回款	6,845,738.29	5,812,020.33	12,657,758.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-91,418,044.68	-77,286,840.81	-168,704,885.49

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	47,985.90
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	2,696.08
其他	92.55
合计	50,774.53

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,358,189.37
股票投资收益——赎回差价收入	-2,799,759.49
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	-21,157,948.86
----	----------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	55,781,690.57
减：卖出股票成本总额	73,969,290.76
减：交易费用	170,589.18
买卖股票差价收入	-18,358,189.37

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	42,342,241.38
减：现金支付赎回款总额	27,914,560.38
减：赎回股票成本总额	17,227,440.49
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,799,759.49

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,897,088.36
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	5,897,088.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	19,266,352.01

股票投资	19,266,352.01
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	19,266,352.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	83,442.39
合计	83,442.39

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,264.29
其他	7,726.07
合计	118,086.30

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,271,495.70	1,569,656.78
其中：支付销售机构的客户维护费	14,501.56	15,518.12

注：支付基金管理人银华基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管

理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	254,299.05	313,931.40

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	24,211,042.02	47,985.90	31,660,415.90	58,412.74

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）发行的股票：招商银行（代码 600036）167,400.00 股，期末公允价值为人民币 5,484,024.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.12%；招商银行（代码 3968）62,000.00 股，期末公允价值为人民币 2,034,994.26 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.42%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：中国交建（代码 601800）48,000.00 股，期末公允价值为人民币 523,680.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.11%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：上汽集团（600104）63,300.00 股，期末公允价值为人民币 896,961.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.18%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

	科技	月 16 日		受限						
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,063	32,793.55	25,118.69	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	631	24,060.03	19,579.93	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,026	27,496.80	22,900.32	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	691	16,425.07	29,636.99	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信	2023 年 6 月	6 个月	新股流通	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-

	新材	月 21 日		受限							
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	配股流通受限	2.02	2.64	40,140	81,082.80	105,969.60	-	
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-	
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-	
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-	
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
03333	中国恒大	2022 年 03 月 21 日	重大事项停牌	1.52	2023 年 8 月 28 日	0.20	34,000	441,850.87	51,723.08	-

06666	恒大 物业	2022 年 03 月 21 日	重大事 项停牌	2.12	2023 年 08 月 03 日	1.34	75,500	545,718.43	160,101.83	-
00813	世贸 集团	2022 年 04 月 01 日	重大事 项停牌	4.08	2023 年 07 月 31 日	1.83	26,500	518,589.22	107,991.52	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

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

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

以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,211,042.02	-	-	-	24,211,042.02
结算备付金	11,513.19	-	-	-	11,513.19
存出保证金	87,043.97	-	-	-	87,043.97
交易性金融资产	-	-	-	-463,899,637.96	463,899,637.96
应收股利	-	-	-	1,063,528.73	1,063,528.73
应收清算款	-	-	-	308,602.91	308,602.91
资产总计	24,309,599.18	-	-	-465,271,769.60	489,581,368.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	200,889.42	200,889.42
应付托管费	-	-	-	40,177.88	40,177.88
应付清算款	-	-	-	40.68	40.68
其他负债	-	-	-	252,146.29	252,146.29
负债总计	-	-	-	493,254.27	493,254.27
利率敏感度缺口	24,309,599.18	-	-	-464,778,515.33	489,088,114.51
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,414,618.75	-	-	-	28,414,618.75
结算备付金	13,878.30	-	-	-	13,878.30
存出保证金	11,972.36	-	-	-	11,972.36
交易性金融资产	-	-	-	-489,464,640.56	489,464,640.56
应收股利	-	-	-	17,381.66	17,381.66
资产总计	28,440,469.41	-	-	-489,482,022.22	517,922,491.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	221,563.95	221,563.95
应付托管费	-	-	-	44,312.79	44,312.79
应付清算款	-	-	-	43.46	43.46
其他负债	-	-	-	277,423.60	277,423.60
负债总计	-	-	-	543,343.80	543,343.80
利率敏感度缺口	28,440,469.41	-	-	-488,938,678.42	517,379,147.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	187,050,655.68	-	187,050,655.68
资产合计	-	187,050,655.68	-	187,050,655.68
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	187,050,655.68	-	187,050,655.68
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	198,403,228.34	-	198,403,228.34
资产合计	-	198,403,228.34	-	198,403,228.34
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	198,403,228.34	-	198,403,228.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变	
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币 5%	9,352,532.78	9,920,161.42
	港币-5%	-9,352,532.78	-9,920,161.42

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	463,899,637.96	94.85	489,464,640.56	94.60
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	463,899,637.96	94.85	489,464,640.56	94.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	23,782,553.02	24,972,445.09
	业绩比较基准下降 5%	-23,782,553.02	-24,972,445.09

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	463,290,749.13	487,327,209.61
第二层次	380,033.98	509,130.70
第三层次	228,854.85	1,628,300.25
合计	463,899,637.96	489,464,640.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可

观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	463,899,637.96	94.75
	其中：股票	463,899,637.96	94.75
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	24,222,555.21	4.95
8	其他各项资产	1,459,175.61	0.30
9	合计	489,581,368.78	100.00

注：1、股票投资含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 187,050,655.68 元，占期末净值比例为 38.24%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,860,565.00	0.58
B	采矿业	10,397,452.00	2.13

C	制造业	160,507,094.58	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,930,377.00	1.62
E	建筑业	6,057,261.60	1.24
F	批发和零售业	1,104,815.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	6,150,974.00	1.26
H	住宿和餐饮业	262,508.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,488,701.01	2.96
J	金融业	54,864,015.82	11.22
K	房地产业	3,828,858.00	0.78
L	租赁和商务服务业	2,390,604.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	2,938,763.60	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	120,819.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,758,190.40	0.36
R	文化、体育和娱乐业	653,041.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	276,314,040.01	56.50

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	510,511.47	0.10
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,036.32	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	534,942.27	0.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,382,509.01	0.28
消费者非必需品	28,294,689.40	5.79
消费者常用品	8,629,161.18	1.76
能源	6,749,912.40	1.38
金融	64,822,712.77	13.25
医疗保健	6,529,744.48	1.34
工业	7,479,734.24	1.53
信息技术	7,797,098.20	1.59
电信服务	37,600,138.57	7.69
公用事业	6,629,978.01	1.36
地产建筑业	11,134,977.42	2.28
合计	187,050,655.68	38.24

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	90,700	27,729,581.12	5.67
2	00005	汇丰控股	273,600	15,387,477.41	3.15
3	600519	贵州茅台	8,500	14,373,500.00	2.94
4	01299	友邦保险	156,600	11,420,621.58	2.34
5	601318	中国平安	146,400	6,792,960.00	1.39
5	02318	中国平安	100,500	4,619,050.65	0.94
6	03690	美团-W	84,420	9,519,043.36	1.95
7	300750	宁德时代	35,691	8,165,743.89	1.67
8	00939	建设银行	1,625,000	7,595,962.73	1.55
8	601939	建设银行	90,700	567,782.00	0.12

9	00941	中国移动	110,500	6,525,336.50	1.33
9	600941	中国移动	12,200	1,138,260.00	0.23
10	600036	招商银行	167,400	5,484,024.00	1.12
10	03968	招商银行	62,000	2,034,994.26	0.42
11	01398	工商银行	1,173,000	4,520,597.02	0.92
11	601398	工商银行	473,700	2,283,234.00	0.47
12	01211	比亚迪股份	15,000	3,457,425.00	0.71
12	002594	比亚迪	12,300	3,176,721.00	0.65
13	00388	香港交易所	17,100	4,654,081.28	0.95
14	03988	中国银行	1,130,000	3,271,369.44	0.67
14	601988	中国银行	284,900	1,113,959.00	0.23
15	000858	五粮液	26,232	4,290,768.24	0.88
16	000333	美的集团	66,500	3,918,180.00	0.80
17	601899	紫金矿业	222,700	2,532,099.00	0.52
17	02899	紫金矿业	78,000	827,016.06	0.17
18	601328	交通银行	371,400	2,154,120.00	0.44
18	03328	交通银行	237,000	1,134,063.06	0.23
19	601166	兴业银行	196,500	3,075,225.00	0.63
20	600030	中信证券	131,910	2,609,179.80	0.53
20	06030	中信证券	35,500	464,770.12	0.10
21	600028	中国石化	257,400	1,637,064.00	0.33
21	00386	中国石油化工股份	334,000	1,413,450.66	0.29
22	00883	中国海洋石油	241,000	2,488,608.42	0.51
22	600938	中国海油	24,400	442,128.00	0.09
23	600900	长江电力	132,400	2,920,744.00	0.60
24	600276	恒瑞医药	60,340	2,890,286.00	0.59
25	601288	农业银行	431,100	1,521,783.00	0.31
25	01288	农业银行	415,000	1,178,474.84	0.24
26	00857	中国石油股份	286,000	1,429,179.64	0.29
26	601857	中国石油	153,200	1,144,404.00	0.23
27	688981	中芯国际	26,456	1,336,557.12	0.27
27	00981	中芯国际	64,500	1,213,141.28	0.25
28	600887	伊利股份	86,200	2,441,184.00	0.50
29	300059	东方财富	171,399	2,433,865.80	0.50
30	601088	中国神华	44,600	1,371,450.00	0.28
30	01088	中国神华	45,500	1,004,704.66	0.21
31	02888	渣打集团	38,050	2,364,482.25	0.48
32	601012	隆基绿能	81,960	2,349,793.20	0.48
33	01810	小米集团-W	236,800	2,340,442.54	0.48
34	09987	百胜中国	5,650	2,300,376.98	0.47
35	600309	万华化学	25,500	2,239,920.00	0.46
36	000651	格力电器	60,900	2,223,459.00	0.45
37	002475	立讯精密	67,600	2,193,620.00	0.45

38	09633	农夫山泉	54,400	2,169,234.54	0.44
39	00016	新鸿基地产	23,500	2,138,486.51	0.44
40	02015	理想汽车-W	16,900	2,111,288.10	0.43
41	002415	海康威视	63,300	2,095,863.00	0.43
42	000568	泸州老窖	10,000	2,095,700.00	0.43
43	600690	海尔智家	51,100	1,199,828.00	0.25
43	06690	海尔智家	38,600	877,254.75	0.18
44	000725	京东方 A	506,500	2,071,585.00	0.42
45	01024	快手-W	41,100	2,029,190.39	0.41
46	02628	中国人寿	100,000	1,204,105.88	0.25
46	601628	中国人寿	22,600	790,096.00	0.16
47	300760	迈瑞医疗	6,600	1,978,680.00	0.40
48	02269	药明生物	57,000	1,973,359.89	0.40
49	000063	中兴通讯	43,100	1,962,774.00	0.40
50	00669	创科实业	25,000	1,962,664.93	0.40
51	601601	中国太保	46,300	1,202,874.00	0.25
51	02601	中国太保	37,600	701,995.57	0.14
52	603259	药明康德	27,760	1,729,725.60	0.35
53	002230	科大讯飞	25,000	1,699,000.00	0.35
54	06160	百济神州	16,800	1,663,546.95	0.34
55	300274	阳光电源	14,000	1,632,820.00	0.33
56	601668	中国建筑	283,100	1,624,994.00	0.33
57	300124	汇川技术	25,150	1,614,881.50	0.33
58	00027	银河娱乐	35,000	1,603,784.21	0.33
59	00001	长和	36,000	1,588,202.75	0.32
60	002714	牧原股份	37,000	1,559,550.00	0.32
61	00002	中电控股	27,500	1,544,086.01	0.32
62	002352	顺丰控股	33,100	1,492,479.00	0.31
63	000001	平安银行	131,200	1,473,376.00	0.30
64	01109	华润置地	48,000	1,469,267.33	0.30
65	601888	中国中免	13,200	1,458,996.00	0.30
66	601658	邮储银行	149,700	732,033.00	0.15
66	01658	邮储银行	162,000	719,918.86	0.15
67	002129	TCL 中环	43,675	1,450,010.00	0.30
68	02020	安踏体育	19,200	1,417,046.38	0.29
69	000792	盐湖股份	73,400	1,407,078.00	0.29
70	02331	李宁	35,500	1,379,581.72	0.28
71	002142	宁波银行	53,490	1,353,297.00	0.28
72	601138	工业富联	53,600	1,350,720.00	0.28
73	600031	三一重工	80,400	1,337,052.00	0.27
74	300498	温氏股份	70,900	1,301,015.00	0.27
75	000002	万 科 A	92,000	1,289,840.00	0.26
76	600048	保利发展	97,100	1,265,213.00	0.26

77	600016	民生银行	336,200	1,260,750.00	0.26
78	02388	中银香港	57,000	1,258,641.00	0.26
79	600438	通威股份	36,600	1,255,746.00	0.26
80	600406	国电南瑞	54,275	1,253,752.50	0.26
81	600050	中国联通	257,900	1,237,920.00	0.25
82	600809	山西汾酒	6,560	1,214,059.20	0.25
83	688111	金山办公	2,569	1,213,133.18	0.25
84	600837	海通证券	130,700	1,205,054.00	0.25
85	601728	中国电信	210,200	1,183,426.00	0.24
86	600919	江苏银行	160,000	1,176,000.00	0.24
87	600436	片仔癀	4,100	1,174,076.00	0.24
88	600089	特变电工	52,600	1,172,454.00	0.24
89	300015	爱尔眼科	63,128	1,171,024.40	0.24
90	02319	蒙牛乳业	43,000	1,169,531.63	0.24
91	01113	长实集团	29,000	1,160,404.03	0.24
92	600000	浦发银行	158,800	1,149,712.00	0.24
93	002371	北方华创	3,600	1,143,540.00	0.23
94	603501	韦尔股份	11,270	1,104,910.80	0.23
95	600585	海螺水泥	32,400	769,176.00	0.16
95	00914	海螺水泥	17,500	335,600.72	0.07
96	002304	洋河股份	8,200	1,077,070.00	0.22
97	01928	金沙中国有限公司	43,600	1,073,295.36	0.22
98	601766	中国中车	164,300	1,067,950.00	0.22
99	00011	恒生银行	10,300	1,058,847.93	0.22
100	603288	海天味业	22,561	1,056,982.85	0.22
101	601390	中国中铁	138,800	1,052,104.00	0.22
102	00291	华润啤酒	22,000	1,046,631.70	0.21
103	600905	三峡能源	193,600	1,039,632.00	0.21
104	00168	青岛啤酒股份	8,000	525,159.81	0.11
104	600600	青岛啤酒	4,800	497,424.00	0.10
105	00267	中信股份	118,000	1,017,220.53	0.21
106	300014	亿纬锂能	16,600	1,004,300.00	0.21
107	600150	中国船舶	30,200	993,882.00	0.20
108	000938	紫光股份	30,900	984,165.00	0.20
109	002466	天齐锂业	14,000	978,740.00	0.20
110	603986	兆易创新	9,080	964,750.00	0.20
111	02688	新奥能源	10,700	962,842.15	0.20
112	601688	华泰证券	69,600	958,392.00	0.20
113	601225	陕西煤业	52,400	953,156.00	0.19
114	00003	香港中华煤气	151,950	948,442.21	0.19
115	002027	分众传媒	136,800	931,608.00	0.19
116	002460	赣锋锂业	15,280	931,468.80	0.19
117	002459	晶澳科技	22,284	929,242.80	0.19

118	00688	中国海外发展	59,000	929,097.69	0.19
119	601169	北京银行	200,500	928,315.00	0.19
120	600570	恒生电子	20,612	912,905.48	0.19
121	000338	潍柴动力	73,200	912,072.00	0.19
122	688012	中微公司	5,783	904,750.35	0.18
123	01997	九龙仓置业	25,000	902,387.93	0.18
124	601985	中国核电	127,500	898,875.00	0.18
125	600104	上汽集团	63,300	896,961.00	0.18
126	002050	三花智控	29,100	880,566.00	0.18
127	000625	长安汽车	67,084	867,396.12	0.18
128	002049	紫光国微	9,240	861,630.00	0.18
129	601211	国泰君安	61,000	853,390.00	0.17
130	02313	申洲国际	12,200	840,799.66	0.17
131	00066	港铁公司	25,000	829,782.00	0.17
132	600111	北方稀土	34,200	820,116.00	0.17
133	601919	中远海控	86,170	809,998.00	0.17
134	603019	中科曙光	15,800	804,220.00	0.16
135	01093	石药集团	128,000	803,671.53	0.16
136	000100	TCL 科技	203,580	802,105.20	0.16
137	603799	华友钴业	17,290	793,783.90	0.16
138	01171	兖矿能源	20,000	413,969.02	0.08
138	600188	兖矿能源	12,400	371,008.00	0.08
139	06618	京东健康	17,200	784,180.87	0.16
140	002179	中航光电	17,222	781,017.70	0.16
141	601229	上海银行	134,784	775,008.00	0.16
142	600660	福耀玻璃	21,600	774,360.00	0.16
143	002812	恩捷股份	8,000	770,800.00	0.16
144	601818	光大银行	251,000	770,570.00	0.16
145	600893	航发动力	18,100	764,906.00	0.16
146	600009	上海机场	16,800	763,056.00	0.16
147	00006	电能实业	20,000	756,945.58	0.15
148	02328	中国财险	94,000	754,861.91	0.15
149	09868	小鹏汽车-W	16,300	751,413.70	0.15
150	02382	舜宇光学科技	10,400	749,348.46	0.15
151	002271	东方雨虹	27,200	741,472.00	0.15
152	601989	中国重工	153,700	740,834.00	0.15
153	00992	联想集团	98,000	738,192.51	0.15
154	002555	三七互娱	21,000	732,480.00	0.15
155	00998	中信银行	141,000	478,396.98	0.10
155	601998	中信银行	41,300	246,974.00	0.05
156	00175	吉利汽车	82,000	722,758.56	0.15
157	300122	智飞生物	16,150	713,830.00	0.15
158	600958	东方证券	70,620	685,014.00	0.14

159	600999	招商证券	50,100	679,857.00	0.14
160	600019	宝钢股份	120,500	677,210.00	0.14
161	000977	浪潮信息	13,900	674,150.00	0.14
162	600760	中航沈飞	14,941	672,345.00	0.14
163	300896	爱美客	1,500	667,425.00	0.14
164	002709	天赐材料	15,700	646,683.00	0.13
165	688036	传音控股	4,254	625,338.00	0.13
166	300316	晶盛机电	8,800	623,920.00	0.13
167	688599	天合光能	14,620	622,958.20	0.13
168	688008	澜起科技	10,843	622,605.06	0.13
169	600426	华鲁恒升	20,160	617,500.80	0.13
170	601186	中国铁建	62,400	614,640.00	0.13
171	002602	世纪华通	80,800	613,272.00	0.13
172	601360	三六零	48,400	606,936.00	0.12
173	00322	康师傅控股	54,000	606,404.69	0.12
174	00960	龙湖集团	34,500	605,630.22	0.12
175	00020	商汤-W	317,000	604,994.06	0.12
176	600584	长电科技	19,300	601,581.00	0.12
177	00968	信义光能	72,000	600,762.17	0.12
178	000661	长春高新	4,400	599,720.00	0.12
179	601006	大秦铁路	80,700	599,601.00	0.12
180	000776	广发证券	40,000	588,400.00	0.12
181	601600	中国铝业	106,900	586,881.00	0.12
182	600522	中天科技	36,800	585,488.00	0.12
183	002410	广联达	17,940	582,870.60	0.12
184	600745	闻泰科技	11,800	577,020.00	0.12
185	002920	德赛西威	3,700	576,497.00	0.12
186	002241	歌尔股份	32,400	575,100.00	0.12
187	300142	沃森生物	21,700	573,965.00	0.12
188	600547	山东黄金	24,400	572,912.00	0.12
189	600588	用友网络	27,936	572,688.00	0.12
190	601377	兴业证券	93,410	571,669.20	0.12
191	000166	申万宏源	121,500	561,330.00	0.11
192	601009	南京银行	69,600	556,800.00	0.11
193	600011	华能国际	59,300	549,118.00	0.11
194	600010	包钢股份	305,900	547,561.00	0.11
195	001979	招商蛇口	41,800	544,654.00	0.11
196	000596	古井贡酒	2,200	544,236.00	0.11
197	600085	同仁堂	9,300	535,308.00	0.11
198	300450	先导智能	14,780	534,592.60	0.11
199	600196	复星医药	17,300	534,570.00	0.11
200	601669	中国电建	93,100	534,394.00	0.11
201	01801	信达生物	19,500	532,166.86	0.11

202	300408	三环集团	18,100	531,235.00	0.11
203	01929	周大福	40,600	527,048.02	0.11
204	002311	海大集团	11,200	524,608.00	0.11
205	601800	中国交建	48,000	523,680.00	0.11
206	603659	璞泰来	13,546	517,728.12	0.11
207	000963	华东医药	11,900	516,103.00	0.11
208	01821	ESR	41,400	513,004.42	0.10
209	000538	云南白药	9,720	510,105.60	0.10
210	603993	洛阳钼业	95,700	510,081.00	0.10
211	600886	国投电力	40,200	508,530.00	0.10
212	300033	同花顺	2,900	508,312.00	0.10
213	00788	中国铁塔	632,000	506,941.48	0.10
214	000768	中航西飞	18,800	502,900.00	0.10
215	00083	信和置业	56,000	497,205.37	0.10
216	600845	宝信软件	9,674	491,535.94	0.10
217	300782	卓胜微	5,084	491,266.92	0.10
218	03800	协鑫科技	293,000	488,953.65	0.10
219	601689	拓普集团	6,000	484,200.00	0.10
220	002340	格林美	69,800	482,318.00	0.10
221	002384	东山精密	18,500	479,150.00	0.10
222	002493	荣盛石化	41,150	478,986.00	0.10
223	01177	中国生物制药	152,000	477,880.67	0.10
224	002252	上海莱士	63,600	477,636.00	0.10
225	06862	海底捞	30,000	476,848.06	0.10
226	600926	杭州银行	40,200	472,350.00	0.10
227	000733	振华科技	4,900	469,665.00	0.10
228	00288	万洲国际	122,000	466,798.47	0.10
229	600015	华夏银行	85,900	464,719.00	0.10
230	600795	国电电力	121,200	464,196.00	0.09
231	601100	恒立液压	7,200	463,176.00	0.09
232	601916	浙商银行	175,340	462,897.60	0.09
233	600372	中航电子	30,446	462,170.28	0.09
234	600176	中国巨石	32,594	461,531.04	0.09
235	002180	纳思达	13,400	458,950.00	0.09
236	300347	泰格医药	7,100	458,234.00	0.09
237	600732	爱旭股份	14,800	455,100.00	0.09
238	000157	中联重科	67,100	452,925.00	0.09
239	600674	川投能源	30,000	451,500.00	0.09
240	603369	今世缘	8,500	448,800.00	0.09
241	002236	大华股份	22,500	444,375.00	0.09
242	00019	太古股份公司 A	8,000	442,919.19	0.09
243	600115	中国东航	93,000	442,680.00	0.09
244	300012	华测检测	22,700	442,650.00	0.09

245	00881	中升控股	16,000	441,812.82	0.09
246	00868	信义玻璃	39,000	438,678.08	0.09
247	600029	南方航空	72,500	437,175.00	0.09
248	01876	百威亚太	23,200	432,076.71	0.09
249	000425	徐工机械	63,800	431,926.00	0.09
250	00012	恒基地产	20,000	429,642.68	0.09
251	00836	华润电力	26,000	424,295.20	0.09
252	601066	中信建投	17,500	423,500.00	0.09
253	000301	东方盛虹	35,800	423,156.00	0.09
254	601995	中金公司	11,900	422,688.00	0.09
255	03888	金山软件	14,800	420,957.63	0.09
256	601788	光大证券	26,400	419,496.00	0.09
257	601633	长城汽车	16,600	417,822.00	0.09
258	09626	哔哩哔哩-W	3,880	417,468.86	0.09
259	300496	中科创达	4,300	414,305.00	0.08
260	601336	新华保险	11,200	411,824.00	0.08
261	601117	中国化学	49,700	411,516.00	0.08
262	600346	恒力石化	28,700	411,271.00	0.08
263	603345	安井食品	2,800	411,040.00	0.08
264	601868	中国能建	175,200	409,968.00	0.08
265	601877	正泰电器	14,600	403,690.00	0.08
266	300003	乐普医疗	17,800	402,458.00	0.08
267	002074	国轩高科	14,400	397,728.00	0.08
268	002202	金风科技	37,400	397,188.00	0.08
269	600702	舍得酒业	3,200	396,640.00	0.08
270	688777	中控技术	6,302	395,639.56	0.08
271	600741	华域汽车	21,300	393,198.00	0.08
272	00762	中国联通	82,000	391,620.22	0.08
273	601111	中国国航	47,000	387,280.00	0.08
274	300454	深信服	3,400	385,050.00	0.08
275	002001	新和成	25,000	385,000.00	0.08
276	601618	中国中冶	96,800	384,296.00	0.08
277	688126	沪硅产业	18,367	383,870.30	0.08
278	00151	中国旺旺	80,000	383,543.68	0.08
279	01038	长江基建集团	10,000	382,160.71	0.08
280	00916	龙源电力	45,000	334,817.04	0.07
280	001289	龙源电力	2,100	47,250.00	0.01
281	688223	晶科能源	27,120	381,307.20	0.08
282	002841	视源股份	5,700	380,988.00	0.08
283	002821	凯莱英	3,220	379,509.20	0.08
284	603806	福斯特	10,184	378,742.96	0.08
285	601555	东吴证券	54,378	377,383.32	0.08
286	600989	宝丰能源	29,800	375,778.00	0.08

287	688396	华润微	7,061	370,067.01	0.08
288	601838	成都银行	30,300	369,963.00	0.08
289	600765	中航重机	13,900	368,489.00	0.08
290	00268	金蝶国际	38,000	367,169.32	0.08
291	601901	方正证券	55,900	365,586.00	0.07
292	601615	明阳智能	21,600	364,608.00	0.07
293	00384	中国燃气	44,000	363,887.07	0.07
294	300037	新宙邦	7,000	363,230.00	0.07
295	600885	宏发股份	11,320	360,542.00	0.07
296	300661	圣邦股份	4,387	360,304.31	0.07
297	000876	新希望	30,800	359,744.00	0.07
298	000066	中国长城	26,000	359,580.00	0.07
299	000807	云铝股份	28,200	358,986.00	0.07
300	00017	新世界发展	20,000	355,515.49	0.07
301	688303	大全能源	8,751	353,977.95	0.07
302	605117	德业股份	2,340	349,947.00	0.07
303	688122	西部超导	6,248	348,201.04	0.07
304	300413	芒果超媒	10,100	345,521.00	0.07
305	000895	双汇发展	14,100	345,309.00	0.07
306	600460	士兰微	11,400	345,078.00	0.07
307	600039	四川路桥	35,160	344,919.60	0.07
308	603392	万泰生物	5,163	344,733.51	0.07
309	01066	威高股份	36,400	343,655.14	0.07
310	600233	圆通速递	23,400	340,704.00	0.07
311	688099	晶晨股份	4,040	340,652.80	0.07
312	002648	卫星化学	22,732	340,070.72	0.07
313	002736	国信证券	38,800	338,724.00	0.07
314	000786	北新建材	13,800	338,238.00	0.07
315	601607	上海医药	15,000	336,150.00	0.07
316	603260	合盛硅业	4,800	336,096.00	0.07
317	300146	汤臣倍健	13,900	333,322.00	0.07
318	300769	德方纳米	3,020	332,894.60	0.07
319	002007	华兰生物	14,800	331,668.00	0.07
320	003816	中国广核	106,600	331,526.00	0.07
321	300207	欣旺达	20,300	331,296.00	0.07
322	01209	华润万象生活	9,200	329,958.20	0.07
323	00135	昆仑能源	58,000	329,405.01	0.07
324	000999	华润三九	5,400	327,564.00	0.07
325	300751	迈为股份	1,920	325,209.60	0.07
326	601108	财通证券	44,240	320,297.60	0.07
327	002601	龙佰集团	19,400	320,100.00	0.07
328	300999	金龙鱼	8,000	319,920.00	0.07
329	300433	蓝思科技	27,000	317,520.00	0.06

330	00241	阿里健康	72,000	312,661.86	0.06
331	601727	上海电气	68,400	312,588.00	0.06
332	601238	广汽集团	29,800	310,516.00	0.06
333	002625	光启技术	20,300	309,778.00	0.06
334	01193	华润燃气	12,500	308,863.30	0.06
335	600383	金地集团	42,800	308,588.00	0.06
336	300759	康龙化成	8,050	308,154.00	0.06
337	300144	宋城演艺	24,800	307,520.00	0.06
338	600027	华电国际	45,900	307,071.00	0.06
339	000783	长江证券	52,500	304,500.00	0.06
340	01044	恒安国际	10,000	304,253.40	0.06
341	600132	重庆啤酒	3,300	304,128.00	0.06
342	603605	珀莱雅	2,700	303,480.00	0.06
343	02618	京东物流	26,800	301,944.76	0.06
344	601233	桐昆股份	22,700	300,775.00	0.06
345	600763	通策医疗	3,100	300,266.00	0.06
346	600332	白云山	9,400	299,672.00	0.06
347	601077	渝农商行	83,200	298,688.00	0.06
348	002008	大族激光	11,400	298,680.00	0.06
349	06098	碧桂园服务	32,000	298,574.00	0.06
350	600096	云天化	17,400	297,018.00	0.06
351	600298	安琪酵母	8,200	296,922.00	0.06
352	002385	大北农	44,600	294,360.00	0.06
353	002603	以岭药业	11,400	292,866.00	0.06
354	01548	金斯瑞生物科技	18,000	292,083.26	0.06
355	300223	北京君正	3,300	291,423.00	0.06
356	603882	金域医学	3,800	286,900.00	0.06
357	600219	南山铝业	94,900	286,598.00	0.06
358	603688	石英股份	2,500	284,600.00	0.06
359	300390	天华新能	7,920	283,536.00	0.06
360	600875	东方电气	15,100	281,615.00	0.06
361	000983	山西焦煤	30,900	281,190.00	0.06
362	300763	锦浪科技	2,700	281,070.00	0.06
363	01972	太古地产	15,800	280,565.89	0.06
364	000799	酒鬼酒	3,100	279,465.00	0.06
365	300073	当升科技	5,500	276,815.00	0.06
366	02007	碧桂园	188,000	275,598.26	0.06
367	00004	九龙仓集团	16,000	274,676.28	0.06
368	600705	中航产融	71,700	274,611.00	0.06
369	603606	东方电缆	5,600	274,568.00	0.06
370	00270	粤海投资	44,000	274,233.73	0.06
371	002240	盛新锂能	8,600	274,082.00	0.06
372	002756	永兴材料	4,370	273,605.70	0.06

373	00285	比亚迪电子	12,500	273,136.58	0.06
374	605358	立昂微	7,300	268,129.00	0.05
375	00101	恒隆地产	24,000	267,742.99	0.05
376	600362	江西铜业	14,000	265,720.00	0.05
377	000723	美锦能源	35,100	264,654.00	0.05
378	002600	领益智造	38,200	263,962.00	0.05
379	06110	滔搏	42,000	262,930.26	0.05
380	601699	潞安环能	16,100	262,752.00	0.05
381	600754	锦江酒店	6,200	262,508.00	0.05
382	600918	中泰证券	37,900	261,889.00	0.05
383	601865	福莱特	6,800	261,868.00	0.05
384	002568	百润股份	7,140	259,539.00	0.05
385	603290	斯达半导	1,200	258,240.00	0.05
386	09688	再鼎医药	13,300	257,509.01	0.05
387	601878	浙商证券	26,000	256,880.00	0.05
388	601872	招商轮船	44,000	254,760.00	0.05
389	300832	新产业	4,300	253,700.00	0.05
390	603816	顾家家居	6,630	252,934.50	0.05
391	601319	中国人保	43,300	252,872.00	0.05
392	603939	益丰药房	6,826	252,562.00	0.05
393	603613	国联股份	6,815	251,677.95	0.05
394	000617	中油资本	34,500	249,435.00	0.05
395	600160	巨化股份	18,100	249,418.00	0.05
396	600563	法拉电子	1,800	247,140.00	0.05
397	600061	国投资本	34,700	247,064.00	0.05
398	06186	中国飞鹤	61,000	245,209.80	0.05
399	000069	华侨城 A	55,300	243,320.00	0.05
400	603589	口子窖	4,900	241,815.00	0.05
401	000408	藏格矿业	10,700	241,499.00	0.05
402	603486	科沃斯	3,100	241,087.00	0.05
403	601696	中银证券	22,600	240,916.00	0.05
404	300628	亿联网络	6,840	239,878.80	0.05
405	603833	欧派家居	2,500	239,500.00	0.05
406	600026	中远海能	18,900	238,896.00	0.05
407	01308	海丰国际	18,000	237,317.65	0.05
408	600803	新奥股份	12,500	237,250.00	0.05
409	601799	星宇股份	1,900	234,840.00	0.05
410	600884	杉杉股份	15,500	234,670.00	0.05
411	300601	康泰生物	9,140	232,064.60	0.05
412	600141	兴发集团	10,400	231,088.00	0.05
413	03311	中国建筑国际	28,000	230,531.88	0.05
414	688363	华熙生物	2,578	229,854.48	0.05
415	688063	派能科技	1,157	229,375.25	0.05

416	000629	钒钛股份	58,400	228,344.00	0.05
417	002938	鹏鼎控股	9,400	228,326.00	0.05
418	688005	容百科技	4,215	227,694.30	0.05
419	00144	招商局港口	22,000	224,336.17	0.05
420	603899	晨光股份	5,000	223,200.00	0.05
421	600183	生益科技	15,700	222,940.00	0.05
422	300919	中伟股份	3,700	222,925.00	0.05
423	601966	玲珑轮胎	10,000	222,200.00	0.05
424	01378	中国宏桥	37,500	219,892.23	0.04
425	300595	欧普康视	7,200	217,368.00	0.04
426	000708	中信特钢	13,700	217,008.00	0.04
427	688536	思瑞浦	976	212,768.00	0.04
428	002916	深南电路	2,800	211,036.00	0.04
429	603198	迎驾贡酒	3,300	210,540.00	0.04
430	002353	杰瑞股份	8,300	208,579.00	0.04
431	601898	中煤能源	24,500	206,780.00	0.04
432	603185	弘元绿能	2,760	205,758.00	0.04
433	601881	中国银河	17,600	204,336.00	0.04
434	688180	君实生物	5,282	203,568.28	0.04
435	000703	恒逸石化	30,000	203,400.00	0.04
436	600018	上港集团	37,700	197,925.00	0.04
437	00316	东方海国际	2,000	193,800.20	0.04
438	000877	天山股份	23,500	191,290.00	0.04
439	603517	绝味食品	5,100	189,465.00	0.04
440	002080	中材科技	9,200	188,784.00	0.04
441	002120	韵达股份	19,500	186,420.00	0.04
442	03692	翰森制药	16,000	185,871.17	0.04
443	601216	君正集团	45,200	185,320.00	0.04
444	002064	华峰化学	27,000	185,220.00	0.04
445	06969	思摩尔国际	25,000	183,474.02	0.04
446	603737	三棵树	2,800	183,176.00	0.04
447	002414	高德红外	23,305	181,079.85	0.04
448	601155	新城控股	12,300	177,243.00	0.04
449	03998	波司登	58,000	176,466.97	0.04
450	002939	长城证券	21,700	176,421.00	0.04
451	600025	华能水电	24,500	174,685.00	0.04
452	603893	瑞芯微	2,300	167,555.00	0.03
453	603456	九洲药业	6,115	167,428.70	0.03
454	00656	复星国际	33,500	166,168.46	0.03
455	02588	中银航空租赁	2,800	163,540.81	0.03
456	600606	绿地控股	57,000	156,750.00	0.03
457	688032	禾迈股份	441	156,621.15	0.03
458	603195	公牛集团	1,600	153,696.00	0.03

459	600779	水井坊	2,600	153,374.00	0.03
460	300529	健帆生物	6,600	152,988.00	0.03
461	300957	贝泰妮	1,700	151,096.00	0.03
462	688779	长远锂科	13,296	149,845.92	0.03
463	688187	时代电气	3,416	142,993.76	0.03
464	301269	华大九天	1,100	135,124.00	0.03
465	003022	联泓新科	5,400	134,460.00	0.03
466	601231	环旭电子	8,900	133,144.00	0.03
467	000987	越秀资本	20,730	131,635.50	0.03
468	00293	国泰航空	17,000	125,546.02	0.03
469	603568	伟明环保	6,900	120,819.00	0.02
470	601698	中国卫通	5,800	115,304.00	0.02
471	601808	中海油服	8,100	112,428.00	0.02
472	688728	格科微	6,730	106,468.60	0.02
473	605499	东鹏饮料	600	103,740.00	0.02
474	300979	华利集团	2,100	102,354.00	0.02
475	002945	华林证券	3,800	51,984.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	06666	恒大物业	75,500	160,101.83	0.03
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
3	00813	世茂集团	26,500	107,991.52	0.02
4	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
5	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
6	03333	中国恒大	34,000	51,723.08	0.01
7	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
8	301358	湖南裕能	691	29,636.99	0.01
9	301260	格力博	1,063	25,118.69	0.01
10	301303	真兰仪表	1,026	22,900.32	0.00
11	301291	明阳电气	631	19,579.93	0.00
12	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
13	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
14	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
15	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
16	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
17	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
18	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
19	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
20	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
21	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	02888	渣打集团	2,272,237.46	0.44
2	00700	腾讯控股	1,551,518.18	0.30
3	01211	比亚迪股份	695,907.16	0.13
3	002594	比亚迪	207,849.00	0.04
4	600519	贵州茅台	894,523.00	0.17
5	600941	中国移动	536,408.00	0.10
5	00941	中国移动	356,026.44	0.07
6	00005	汇丰控股	738,370.68	0.14
7	300750	宁德时代	612,099.00	0.12
8	01299	友邦保险	596,457.99	0.12
9	600028	中国石化	528,860.00	0.10
9	00386	中国石油化工股份	58,596.92	0.01
10	03690	美团-W	517,329.14	0.10
11	600886	国投电力	514,118.00	0.10
12	601916	浙商银行	456,653.80	0.09
13	601318	中国平安	235,504.00	0.05
13	02318	中国平安	215,470.95	0.04
14	09626	哔哩哔哩-W	443,323.95	0.09
15	600905	三峡能源	424,925.00	0.08
16	601899	紫金矿业	354,634.00	0.07
16	02899	紫金矿业	64,842.67	0.01
17	600702	舍得酒业	418,350.00	0.08
18	00939	建设银行	389,240.28	0.08
18	601939	建设银行	14,549.00	0.00
19	688126	沪硅产业	398,131.29	0.08
20	01171	兖矿能源	385,340.53	0.07
20	600188	兖矿能源	9,312.00	0.00

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	3,334,746.01	0.64
2	03690	美团-W	2,602,369.69	0.50
3	00005	汇丰控股	1,620,890.40	0.31
4	01299	友邦保险	1,542,310.60	0.30

5	300750	宁德时代	1,075,896.00	0.21
6	00939	建设银行	835,404.48	0.16
6	601939	建设银行	17,873.00	0.00
7	00941	中国移动	744,318.32	0.14
7	600941	中国移动	9,791.00	0.00
8	02318	中国平安	532,331.19	0.10
8	601318	中国平安	211,438.00	0.04
9	688428	诺诚健华	707,977.11	0.14
10	600900	长江电力	586,494.00	0.11
11	00388	香港交易所	583,504.58	0.11
12	002594	比亚迪	396,867.00	0.08
12	01211	比亚迪股份	186,286.02	0.04
13	000858	五粮液	577,883.00	0.11
14	01398	工商银行	501,793.87	0.10
14	601398	工商银行	74,270.00	0.01
15	00981	中芯国际	467,430.77	0.09
15	688981	中芯国际	47,827.08	0.01
16	600079	人福医药	441,613.00	0.09
17	03968	招商银行	273,378.05	0.05
17	600036	招商银行	162,730.00	0.03
18	02359	药明康德	362,947.11	0.07
18	603259	药明康德	71,296.00	0.01
19	688506	百利天恒	421,802.17	0.08
20	000333	美的集团	404,421.00	0.08

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,509,901.64
卖出股票收入（成交）总额	55,781,690.57

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,043.97
2	应收清算款	308,602.91
3	应收股利	1,063,528.73
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,459,175.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	06666	恒大物业	160,101.83	0.03	重大事项停牌
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.03	新股流通受限
3	00813	世茂集团	107,991.52	0.02	重大事项停牌
4	688603	天承科技	76,505.00	0.02	新股流通受限
5	301261	恒工精密	72,803.70	0.01	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
15,658	42,010.03	47,096,252.00	7.16	610,696,748.00	92.84

8.2 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	方正证券股份有限公司	15,834,188.00	2.41
2	招商证券股份有限公司	6,203,676.00	0.94
3	竞技世界（北京）网络技术有限公司	5,000,000.00	0.76
4	中信建投证券股份有限公司	3,868,688.00	0.59
5	霍尔果斯两比特科技有限公司	3,604,400.00	0.55
6	周勇	3,000,000.00	0.46
6	郑碧珍	3,000,000.00	0.46

6	四川省宜宾晶鹏玻璃制品有限公司	3,000,000.00	0.46
6	但钧	3,000,000.00	0.46
6	那秀影	3,000,000.00	0.46

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。

8.3 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。

8.4 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	1,482,793,000.00
本报告期期初基金份额总额	697,793,000.00
本报告期基金总申购份额	15,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	55,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	657,793,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
华泰证券	4	40,751,267.99	42.99	31,847.75	44.63	-
中泰证券	2	23,552,946.95	24.85	17,221.71	24.13	-
华创证券	2	16,195,328.74	17.09	11,843.36	16.60	-
广发证券	4	11,909,346.72	12.56	8,709.40	12.20	-
中金公司	4	2,375,833.90	2.51	1,737.19	2.43	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

财通证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国融证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 13 日
2	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 13 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 1 月 17 日
4	《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	2023 年 1 月 18 日
5	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 1 月 20 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2023 年 2 月 9 日
8	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 3 月 31 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 4 月 4 日
11	《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	2023 年 4 月 17 日
12	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2023 年 4 月 20 日

	告》	网站	
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 4 月 20 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告》	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	2023 年 4 月 26 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于增加国泰君安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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2023 年 4 月 27 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 5 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 29 日