

银华中证 500 价值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 04 月 07 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
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 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
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 .....	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	500 价值
场内简称	500 价值（扩位证券简称：中证 500 价值 ETF）
基金主代码	562330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 7 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	76,018,919.00 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	2023 年 4 月 18 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。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
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而进行相应调整。</p> <p>本基金标的指数为中证 500 价值指数。</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，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 500 价值指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉
	联系电话	(010)58163000
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	95555

传真	(010) 58163027	0755-83195201
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100738	518040
法定代表人	王珠林	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告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 4 月 7 日(基金合同生效日) - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,397,395.73
本期利润	-629,920.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0035
本期加权平均净值利润率	-0.35%
本期基金份额净值增长率	-4.62%
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	-3,515,266.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0462
期末基金资产净值	72,503,652.25
期末基金份额净值	0.9538
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	-4.62%

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

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

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

4、本基金合同生效日为 2023 年 04 月 07 日，主要财务指标的计算期间为自 2023 年 04 月 07 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.31%	0.78%	-2.72%	0.80%	1.41%	-0.02%
自基金合同生效之日起至今	-4.62%	0.71%	-5.94%	0.77%	1.32%	-0.06%

### 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

500 价值累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2023 年 04 月 07 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

## § 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		
张亦驰先生	本基金的基金经理	2023 年 4 月 7 日	-	8 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 5 月 25 日起担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值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发起式联接基金基金经理，自 2021 年 11 月 23 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 20 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日起兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日起兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中

					国。
马君女士	本基金的基金经理	2023 年 4 月 7 日	-	14.5 年	<p>硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车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 2021 年 2 月 25 日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 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式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联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 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 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券</p>

					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 2022 年 4 月 20 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发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任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基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任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）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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	2023 年 4 月 7 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 500 价值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 0.9538 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.62%，业绩比较基准收益率为-5.94%。

### 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性的观察。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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 2023 年 04 月 07 日至 2023 年 06 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

#### 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 500 价值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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,020,368.66
结算备付金		196,919.11
存出保证金		166,166.12
交易性金融资产	6.4.7.2	70,657,329.16
其中：股票投资		70,657,329.16
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	88,085.28
资产总计		73,128,868.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		30,636.18
应付托管费		6,127.24
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	588,452.66
负债合计		625,216.08
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	76,018,919.00
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,515,266.75
净资产合计		72,503,652.25
负债和净资产总计		73,128,868.33

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9538 元，基金份额总额 76,018,919.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2023 年 04 月 07 日起至 2023 年 06 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 4 月 7 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-345,541.27
1. 利息收入		61,117.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,117.88
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）		3,587,837.72
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,763,453.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,824,384.60
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	-4,027,316.39
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	32,819.52
<b>减：二、营业总支出</b>		284,379.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	198,723.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,744.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	45,910.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-629,920.66
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-629,920.66
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-629,920.66

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 07 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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)	585,018,919.00	-	-	585,018,919.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-509,000,000.00	-	-3,515,266.75	-512,515,266.75
(一)、综合收益总额	-	-	-629,920.66	-629,920.66
(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)	-509,000,000.00	-	-2,885,346.09	-511,885,346.09
其中：1. 基金申购款	16,000,000.00	-	-134,937.39	15,865,062.61
2. 基金赎回款	-525,000,000.00	-	-2,750,408.70	-527,750,408.70
(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)	76,018,919.00	-	-3,515,266.75	72,503,652.25

注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 07 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华中证 500 价值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[2022]3021 号《关于准予银华中证 500 价值交易型

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 500 价值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 585,018,919.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0196 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 585,018,919.00 份基金份额，不含认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]75 号核准，本基金 585,018,919.00 份基金份额于 2023 年 4 月 18 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 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转换公司债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证 500 价值指数收益率。

#### 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

本基金 2023 年 04 月 07 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 04 月 07 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 04 月 07 日（基金合同生效日）起至 2023 年 06 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显

著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为



负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]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。

(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。

(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	2,020,368.66
等于：本金	2,020,122.14
加：应计利息	246.52
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	2,020,368.66

#### 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	74,684,645.55	-	70,657,329.16	-4,027,316.39
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	74,684,645.55	-	70,657,329.16	-4,027,316.39

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	88,085.28
合计	88,085.28

#### 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	569,493.41
其中：交易所市场	569,493.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	18,959.25
合计	588,452.66

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	585,018,919.00	585,018,919.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-525,000,000.00	-525,000,000.00
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	76,018,919.00	76,018,919.00

## 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,397,395.73	-4,027,316.39	-629,920.66
本期基金份额交易产生的变动数	-2,225,421.72	-659,924.37	-2,885,346.09
其中：基金申购款	178,104.74	-313,042.13	-134,937.39
基金赎回款	-2,403,526.46	-346,882.24	-2,750,408.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,171,974.01	-4,687,240.76	-3,515,266.75

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	53,013.91
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	7,690.10	
其他	413.87	
合计	61,117.88	

## 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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日	

股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,626,599.17
股票投资收益——赎回差价收入	4,390,052.29
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,763,453.12

#### 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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	188,837,053.55
减：卖出股票成本总额	190,643,980.37
减：交易费用	819,672.35
买卖股票差价收入	-2,626,599.17

#### 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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	527,750,408.70
减：现金支付赎回款总额	174,933,432.70
减：赎回股票成本总额	348,426,923.71
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,390,052.29

#### 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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,824,384.60
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	1,824,384.60

## 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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,027,316.39
股票投资	-4,027,316.39
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	-4,027,316.39

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-115,558.36
利息	148,377.88
合计	32,819.52

## 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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	18,959.25
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,536.81
其他	24,414.72
合计	45,910.78



#### 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
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西南证券	340,068,634.17	43.64

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	248,692.34	43.67	248,692.34	43.67

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月7日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%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

##### 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 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,020,368.66	53,013.91

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

无。

## 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

注：无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	------	--------	-----	--------	-------	--------	--------	----

	称				期					
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	26,200	173,964.91	182,614.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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	2,020,368.66	-	-	-	2,020,368.66
结算备付金	196,919.11	-	-	-	196,919.11
存出保证金	166,166.12	-	-	-	166,166.12
交易性金融资产	-	-	-	70,657,329.16	70,657,329.16
其他资产	-	-	-	88,085.28	88,085.28
资产总计	2,383,453.89	-	-	70,745,414.44	73,128,868.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	30,636.18	30,636.18
应付托管费	-	-	-	6,127.24	6,127.24
其他负债	-	-	-	588,452.66	588,452.66
负债总计	-	-	-	625,216.08	625,216.08
利率敏感度缺口	2,383,453.89	-	-	70,120,198.36	72,503,652.25

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	70,657,329.16	97.45
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	70,657,329.16	97.45

#### 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）
	业绩比较基准上升 5%	3,243,836.73
	业绩比较基准下降 5%	-3,243,836.73

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

#### 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
第一层次	70,474,715.16
第二层次	182,614.00
第三层次	-
合计	70,657,329.16

#### 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	70,657,329.16	96.62
	其中：股票	70,657,329.16	96.62
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	2,217,287.77	3.03
8	其他各项资产	254,251.40	0.35
9	合计	73,128,868.33	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,406,348.00	6.08
C	制造业	31,122,039.68	42.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,311,350.00	10.08
E	建筑业	1,622,803.00	2.24
F	批发和零售业	4,224,690.00	5.83
G	交通运输、仓储和邮政业	1,937,341.00	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,619,305.20	3.61
J	金融业	13,467,368.20	18.57
K	房地产业	1,954,970.00	2.70
L	租赁和商务服务业	716,238.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,274,876.08	1.76
S	综合	-	-
	合计	70,657,329.16	97.45

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600157	永泰能源	830,300	1,179,026.00	1.63
2	600489	中金黄金	108,700	1,122,871.00	1.55
3	601555	东吴证券	149,700	1,038,918.00	1.43
4	000807	云铝股份	77,700	989,121.00	1.36
5	600352	浙江龙盛	97,200	908,820.00	1.25
6	002966	苏州银行	137,000	897,350.00	1.24
7	601108	财通证券	121,500	879,660.00	1.21
8	002624	完美世界	50,700	856,323.00	1.18
9	600027	华电国际	127,200	850,968.00	1.17
10	600109	国金证券	97,400	844,458.00	1.16
11	000783	长江证券	144,600	838,680.00	1.16
12	601077	渝农商行	231,300	830,367.00	1.15
13	600096	云天化	48,000	819,360.00	1.13
14	000630	铜陵有色	275,300	795,617.00	1.10
15	603444	吉比特	1,600	785,776.00	1.08
16	300390	天华新能	21,900	784,020.00	1.08
17	000933	神火股份	58,900	765,700.00	1.06
18	600705	中航产融	198,000	758,340.00	1.05
19	601168	西部矿业	71,200	748,312.00	1.03
20	000932	华菱钢铁	154,900	738,873.00	1.02
21	600066	宇通客车	49,600	731,104.00	1.01
22	600060	海信视像	29,300	725,175.00	1.00
23	601128	常熟银行	102,400	698,368.00	0.96
24	600839	四川长虹	138,000	696,900.00	0.96
25	000591	太阳能	102,200	692,916.00	0.96
26	600873	梅花生物	77,000	687,610.00	0.95
27	000683	远兴能源	94,800	681,612.00	0.94
28	002078	太阳纸业	62,700	670,263.00	0.92
29	600177	雅戈尔	103,800	654,978.00	0.90
30	600141	兴发集团	29,100	646,602.00	0.89
31	600642	申能股份	91,700	640,983.00	0.88
32	000728	国元证券	97,800	637,656.00	0.88
33	600170	上海建工	232,400	625,156.00	0.86
34	002532	天山铝业	104,300	624,757.00	0.86
35	600325	华发股份	63,300	623,505.00	0.86
36	600153	建发股份	56,200	613,142.00	0.85

37	600143	金发科技	69,500	606,735.00	0.84
38	600637	东方明珠	76,510	598,308.20	0.83
39	601577	长沙银行	75,100	582,776.00	0.80
40	601198	东兴证券	72,500	581,450.00	0.80
41	600704	物产中大	116,500	575,510.00	0.79
42	000960	锡业股份	36,900	573,795.00	0.79
43	600021	上海电力	52,600	566,502.00	0.78
44	601997	贵阳银行	109,300	563,988.00	0.78
45	603077	和邦生物	230,900	561,087.00	0.77
46	688009	中国通号	96,677	560,726.60	0.77
47	000623	吉林敖东	34,800	558,192.00	0.77
48	600511	国药股份	14,100	547,785.00	0.76
49	600867	通化东宝	52,200	544,968.00	0.75
50	600998	九州通	52,150	541,317.00	0.75
51	600546	山煤国际	37,000	535,390.00	0.74
52	600348	华阳股份	67,400	533,134.00	0.74
53	601016	节能风电	145,100	532,517.00	0.73
54	600739	辽宁成大	40,000	526,000.00	0.73
55	601636	旗滨集团	60,200	518,924.00	0.72
56	002432	九安医疗	14,500	510,545.00	0.70
57	600863	内蒙华电	121,900	505,885.00	0.70
58	600970	中材国际	39,500	503,625.00	0.69
59	600655	豫园股份	72,900	500,094.00	0.69
60	002092	中泰化学	77,400	499,230.00	0.69
61	000878	云南铜业	44,940	496,587.00	0.68
62	600820	隧道股份	82,200	494,022.00	0.68
63	600528	中铁工业	49,800	492,024.00	0.68
64	600909	华安证券	105,300	491,751.00	0.68
65	002926	华西证券	58,900	489,459.00	0.68
66	600535	天士力	33,600	487,536.00	0.67
67	000039	中集集团	68,900	474,721.00	0.65
68	600008	首创环保	164,500	473,760.00	0.65
69	603156	养元饮品	18,900	466,830.00	0.64
70	002429	兆驰股份	84,600	465,300.00	0.64
71	000060	中金岭南	97,800	464,550.00	0.64
72	601991	大唐发电	139,000	460,090.00	0.63
73	000830	鲁西化工	43,100	455,136.00	0.63
74	600390	五矿资本	84,100	452,458.00	0.62
75	002500	山西证券	80,400	448,632.00	0.62
76	600398	海澜之家	64,600	444,448.00	0.61
77	002128	电投能源	33,500	442,870.00	0.61
78	002936	郑州银行	192,200	442,060.00	0.61
79	601717	郑煤机	34,500	429,525.00	0.59

80	600985	淮北矿业	37,100	427,392.00	0.59
81	000050	深天马 A	45,900	421,362.00	0.58
82	002244	滨江集团	46,500	410,130.00	0.57
83	600566	济川药业	13,800	400,752.00	0.55
84	002958	青农商行	145,300	395,216.00	0.55
85	600208	新湖中宝	159,100	394,568.00	0.54
86	601666	平煤股份	51,900	391,326.00	0.54
87	601000	唐山港	110,600	390,418.00	0.54
88	600282	南钢股份	115,100	387,887.00	0.53
89	600755	厦门国贸	49,800	385,452.00	0.53
90	600959	江苏有线	112,100	378,898.00	0.52
91	300677	英科医疗	17,200	378,400.00	0.52
92	002030	达安基因	36,700	365,899.00	0.50
93	601866	中远海发	148,100	365,807.00	0.50
94	000778	新兴铸管	89,400	364,752.00	0.50
95	000598	兴蓉环境	66,900	363,267.00	0.50
96	600582	天地科技	61,800	360,294.00	0.50
97	000027	深圳能源	53,400	351,906.00	0.49
98	000709	河钢股份	154,400	348,944.00	0.48
99	601992	金隅集团	155,700	339,426.00	0.47
100	600373	中文传媒	25,294	336,916.08	0.46
101	000883	湖北能源	73,600	335,616.00	0.46
102	601665	齐鲁银行	85,600	335,552.00	0.46
103	000825	太钢不锈	85,700	331,659.00	0.46
104	601928	凤凰传媒	28,500	324,900.00	0.45
105	600663	陆家嘴	32,900	324,723.00	0.45
106	603225	新凤鸣	28,500	314,925.00	0.43
107	600801	华新水泥	25,400	313,690.00	0.43
108	601098	中南传媒	26,900	312,040.00	0.43
109	000012	南玻 A	51,300	305,748.00	0.42
110	001227	兰州银行	106,300	304,018.00	0.42
111	000156	华数传媒	34,600	301,020.00	0.42
112	002032	苏泊尔	6,000	300,000.00	0.41
113	600500	中化国际	53,600	298,016.00	0.41
114	000581	威孚高科	18,700	294,525.00	0.41
115	000401	冀东水泥	39,800	293,326.00	0.40
116	002867	周大生	16,400	291,592.00	0.40
117	600022	山东钢铁	199,800	283,716.00	0.39
118	000930	中粮科技	34,900	282,690.00	0.39
119	000785	居然之家	73,300	279,273.00	0.39
120	002423	中粮资本	34,400	275,200.00	0.38
121	601598	中国外运	58,900	274,474.00	0.38
122	600062	华润双鹤	15,600	271,752.00	0.37

123	600782	新钢股份	71,500	265,265.00	0.37
124	600901	江苏金租	62,440	257,877.20	0.36
125	600339	中油工程	62,600	254,782.00	0.35
126	000937	冀中能源	39,600	252,648.00	0.35
127	600409	三友化工	46,300	252,335.00	0.35
128	000898	鞍钢股份	89,500	248,810.00	0.34
129	601187	厦门银行	49,300	247,486.00	0.34
130	000415	渤海租赁	115,700	242,970.00	0.34
131	600507	方大特钢	52,300	242,149.00	0.33
132	600167	联美控股	34,200	238,374.00	0.33
133	601568	北元集团	44,500	234,515.00	0.32
134	600968	海油发展	75,900	233,013.00	0.32
135	600808	马钢股份	90,300	232,071.00	0.32
136	601156	东航物流	17,800	231,400.00	0.32
137	600126	杭钢股份	50,500	219,170.00	0.30
138	000959	首钢股份	58,500	204,750.00	0.28
139	000402	金融街	44,700	202,044.00	0.28
140	601828	美凯龙	40,500	193,995.00	0.27
141	002110	三钢闽光	45,800	193,276.00	0.27
142	002563	森马服饰	30,200	187,844.00	0.26
143	688289	圣湘生物	11,012	185,442.08	0.26
144	601298	青岛港	26,200	182,614.00	0.25
145	600377	宁沪高速	18,500	181,855.00	0.25
146	600623	华谊集团	28,200	175,686.00	0.24
147	600928	西安银行	49,900	175,648.00	0.24
148	600350	山东高速	25,200	160,524.00	0.22
149	001872	招商港口	8,700	150,249.00	0.21
150	601158	重庆水务	21,500	119,540.00	0.16

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600157	永泰能源	10,928,862.00	15.07
2	601555	东吴证券	9,053,500.10	12.49
3	601108	财通证券	8,053,009.70	11.11
4	601699	潞安环能	7,836,045.00	10.81
5	002966	苏州银行	7,800,980.00	10.76
6	601168	西部矿业	7,759,283.00	10.70
7	000630	铜陵有色	7,755,977.00	10.70

8	000932	华菱钢铁	7,726,678.00	10.66
9	601607	上海医药	7,451,181.96	10.28
10	601077	渝农商行	7,306,936.00	10.08
11	601872	招商轮船	7,112,038.00	9.81
12	000783	长江证券	7,103,912.00	9.80
13	600705	中航产融	6,786,386.00	9.36
14	600873	梅花生物	6,671,902.00	9.20
15	600109	国金证券	6,579,509.00	9.07
16	000683	远兴能源	6,518,253.00	8.99
17	002078	太阳纸业	6,391,395.00	8.82
18	600141	兴发集团	6,369,623.00	8.79
19	600027	华电国际	6,265,794.00	8.64
20	002532	天山铝业	6,033,605.00	8.32
21	000728	国元证券	5,863,611.58	8.09
22	603077	和邦生物	5,742,818.00	7.92
23	600177	雅戈尔	5,738,539.00	7.91
24	600867	通化东宝	5,591,887.00	7.71
25	000878	云南铜业	5,529,701.00	7.63
26	600348	华阳股份	5,458,802.00	7.53
27	600637	东方明珠	5,370,973.29	7.41
28	601198	东兴证券	5,244,999.00	7.23
29	600655	豫园股份	5,163,168.00	7.12
30	600153	建发股份	5,128,493.00	7.07
31	601997	贵阳银行	5,083,959.00	7.01
32	600704	物产中大	5,072,091.00	7.00
33	002030	达安基因	4,867,025.00	6.71
34	601636	旗滨集团	4,863,621.00	6.71
35	600839	四川长虹	4,844,500.00	6.68
36	600170	上海建工	4,815,251.00	6.64
37	000623	吉林敖东	4,735,527.00	6.53
38	002092	中泰化学	4,732,035.00	6.53
39	600642	申能股份	4,723,168.00	6.51
40	600060	海信视像	4,709,767.00	6.50
41	600546	山煤国际	4,668,359.00	6.44
42	000960	锡业股份	4,667,441.00	6.44
43	000830	鲁西化工	4,631,874.00	6.39
44	601577	长沙银行	4,594,035.00	6.34
45	688009	中国通号	4,593,601.62	6.34
46	300677	英科医疗	4,560,828.60	6.29
47	600970	中材国际	4,555,968.00	6.28
48	600535	天士力	4,537,566.20	6.26
49	601666	平煤股份	4,478,406.00	6.18
50	000050	深天马 A	4,453,707.00	6.14

51	600325	华发股份	4,432,552.00	6.11
52	002926	华西证券	4,407,771.00	6.08
53	600909	华安证券	4,362,928.14	6.02
54	600998	九州通	4,357,790.00	6.01
55	000750	国海证券	4,314,813.00	5.95
56	600008	首创环保	4,235,057.00	5.84
57	002500	山西证券	4,180,304.00	5.77
58	600820	隧道股份	4,168,083.00	5.75
59	601717	郑煤机	4,141,592.00	5.71
60	000060	中金岭南	4,131,062.00	5.70
61	002244	滨江集团	4,128,027.00	5.69
62	600755	厦门国贸	4,083,793.00	5.63
63	600528	中铁工业	4,082,568.00	5.63
64	600208	新湖中宝	4,076,622.00	5.62
65	002128	电投能源	3,953,313.00	5.45
66	603156	养元饮品	3,945,183.00	5.44
67	600985	淮北矿业	3,892,752.00	5.37
68	600282	南钢股份	3,836,946.00	5.29
69	002936	郑州银行	3,795,339.00	5.23
70	000027	深圳能源	3,761,800.00	5.19
71	600390	五矿资本	3,721,755.00	5.13
72	600863	内蒙华电	3,601,821.00	4.97
73	000039	中集集团	3,580,676.00	4.94
74	600566	济川药业	3,580,259.73	4.94
75	002958	青农商行	3,564,997.00	4.92
76	603858	步长制药	3,546,324.00	4.89
77	600801	华新水泥	3,436,459.00	4.74
78	000778	新兴铸管	3,413,854.00	4.71
79	000825	太钢不锈	3,391,638.00	4.68
80	601005	重庆钢铁	3,342,890.00	4.61
81	000581	威孚高科	3,250,392.00	4.48
82	601866	中远海发	3,238,624.00	4.47
83	000401	冀东水泥	3,235,898.00	4.46
84	600373	中文传媒	3,231,677.04	4.46
85	600959	江苏有线	3,222,196.00	4.44
86	000709	河钢股份	3,209,399.00	4.43
87	600500	中化国际	3,135,946.00	4.33
88	601992	金隅集团	3,130,027.00	4.32
89	601000	唐山港	3,085,695.00	4.26
90	000598	兴蓉环境	3,061,873.00	4.22
91	600663	陆家嘴	3,009,095.80	4.15
92	601128	常熟银行	3,005,503.00	4.15
93	000930	中粮科技	2,986,989.00	4.12

94	601665	齐鲁银行	2,968,749.00	4.09
95	600398	海澜之家	2,919,548.00	4.03
96	000785	居然之家	2,828,266.00	3.90
97	000883	湖北能源	2,812,242.00	3.88
98	000156	华数传媒	2,786,687.00	3.84
99	600022	山东钢铁	2,768,020.00	3.82
100	601098	中南传媒	2,766,478.00	3.82
101	600297	广汇汽车	2,758,909.00	3.81
102	600064	南京高科	2,754,426.00	3.80
103	688289	圣湘生物	2,683,961.63	3.70
104	600126	杭钢股份	2,669,095.00	3.68
105	601928	凤凰传媒	2,656,407.00	3.66
106	603225	新凤鸣	2,636,675.00	3.64
107	002191	劲嘉股份	2,627,749.00	3.62
108	600409	三友化工	2,617,643.00	3.61
109	601991	大唐发电	2,615,483.00	3.61
110	600507	方大特钢	2,611,126.00	3.60
111	601156	东航物流	2,581,810.00	3.56
112	600582	天地科技	2,557,502.00	3.53
113	600567	山鹰国际	2,527,312.00	3.49
114	600782	新钢股份	2,503,837.00	3.45
115	000937	冀中能源	2,480,831.00	3.42
116	600901	江苏金租	2,469,962.00	3.41
117	002048	宁波华翔	2,418,910.00	3.34
118	000898	鞍钢股份	2,350,833.00	3.24
119	601598	中国外运	2,306,890.00	3.18
120	601568	北元集团	2,255,484.00	3.11
121	600062	华润双鹤	2,253,107.00	3.11
122	002423	中粮资本	2,208,232.00	3.05
123	002416	爱施德	2,206,594.00	3.04
124	601187	厦门银行	2,196,075.00	3.03
125	600339	中油工程	2,193,390.00	3.03
126	002867	周大生	2,167,819.00	2.99
127	600808	马钢股份	2,141,958.00	2.95
128	000402	金融街	2,122,153.00	2.93
129	000656	金科股份	2,113,260.00	2.91
130	000959	首钢股份	2,068,589.00	2.85
131	002110	三钢闽光	2,042,759.00	2.82
132	600376	首开股份	1,951,702.00	2.69
133	002948	青岛银行	1,947,131.00	2.69
134	601828	美凯龙	1,893,007.00	2.61
135	600167	联美控股	1,759,231.00	2.43
136	600787	中储股份	1,708,581.00	2.36



137	000415	渤海租赁	1,680,427.00	2.32
138	600623	华谊集团	1,585,378.00	2.19
139	002221	东华能源	1,516,673.00	2.09
140	002563	森马服饰	1,507,157.00	2.08
141	600350	山东高速	1,493,172.00	2.06
142	600377	宁沪高速	1,481,331.00	2.04
143	601298	青岛港	1,475,308.00	2.03
144	600648	外高桥	1,459,629.00	2.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002966	苏州银行	7,687,583.60	10.60
2	000630	铜陵有色	7,155,746.00	9.87
3	000932	华菱钢铁	6,709,608.65	9.25
4	000783	长江证券	6,315,429.36	8.71
5	000683	远兴能源	5,834,513.70	8.05
6	002078	太阳纸业	5,493,244.00	7.58
7	002532	天山铝业	5,320,695.00	7.34
8	000728	国元证券	5,175,281.00	7.14
9	000878	云南铜业	4,871,132.00	6.72
10	000960	锡业股份	4,444,131.00	6.13
11	000623	吉林敖东	4,329,872.00	5.97
12	000750	国海证券	4,301,013.50	5.93
13	002092	中泰化学	4,189,831.00	5.78
14	002030	达安基因	4,125,555.38	5.69
15	000830	鲁西化工	3,998,814.30	5.52
16	002926	华西证券	3,901,055.00	5.38
17	300677	英科医疗	3,856,476.81	5.32
18	000039	中集集团	3,756,293.50	5.18
19	000050	深天马 A	3,754,214.98	5.18
20	000060	中金岭南	3,728,213.72	5.14
21	002500	山西证券	3,673,136.46	5.07
22	002128	电投能源	3,583,290.48	4.94
23	002244	滨江集团	3,537,137.00	4.88
24	000027	深圳能源	3,515,012.93	4.85
25	002936	郑州银行	3,390,433.20	4.68
26	002958	青农商行	3,188,908.00	4.40
27	000778	新兴铸管	3,153,762.00	4.35
28	000825	太钢不锈	2,943,802.00	4.06
29	000709	河钢股份	2,821,515.00	3.89
30	000401	冀东水泥	2,776,010.00	3.83

31	000581	威孚高科	2,763,062.13	3.81
32	000598	兴蓉环境	2,741,642.00	3.78
33	002221	东华能源	2,654,427.80	3.66
34	002191	劲嘉股份	2,569,165.00	3.54
35	000930	中粮科技	2,525,203.00	3.48
36	000883	湖北能源	2,509,310.00	3.46
37	000785	居然之家	2,450,010.00	3.38
38	000156	华数传媒	2,421,686.60	3.34
39	002048	宁波华翔	2,359,835.02	3.25
40	000937	冀中能源	2,317,794.00	3.20
41	000898	鞍钢股份	2,099,804.00	2.90
42	002416	爱施德	2,092,416.28	2.89
43	002423	中粮资本	1,996,223.00	2.75
44	002948	青岛银行	1,974,879.00	2.72
45	002867	周大生	1,912,943.00	2.64
46	000402	金融街	1,863,900.00	2.57
47	000656	金科股份	1,858,139.00	2.56
48	000959	首钢股份	1,823,990.83	2.52
49	002110	三钢闽光	1,801,217.00	2.48
50	000415	渤海租赁	1,547,453.00	2.13

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	590,489,795.83
卖出股票收入（成交）总额	188,837,053.55

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	166,166.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	88,085.28
8	其他	-
9	合计	254,251.40

### 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：基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
806	94,316.28	31,491,074.00	41.43	44,527,845.00	58.57

### 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	招商证券股份有限公司	6,165,696.00	8.11
2	华泰证券股份有限公司	5,094,120.00	6.70
3	招证资本投资有限公司	5,000,000.00	6.58
4	广发证券股份有限公司	4,821,081.00	6.34
5	王一蕾	4,711,900.00	6.20
6	方正证券股份有限公司	4,050,077.00	5.33
7	上海橡杉资产管理有限公司—橡杉星耀尊享 8 期私募证券投资基金	2,481,000.00	3.26
8	海南盛丰私募基金管理有限公司—盛丰优谷私募证券投资基金	1,323,000.00	1.74
9	上海量游资产管理有限公司—量游 1 号基金	1,197,100.00	1.57
10	林静	1,000,000.00	1.32
10	上海洁乐特防锈包装技术有限公司	1,000,000.00	1.32
10	范燕	1,000,000.00	1.32

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（2023 年 4 月 7 日）基金份额总额	585,018,919.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	525,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	76,018,919.00

### § 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

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 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 (%)	
西南证券	4	340,068,634.17	43.64	248,692.34	43.67	-
中信建投	4	256,583,764.98	32.92	187,481.11	32.92	-
长江证券	4	182,674,450.23	23.44	133,319.96	23.41	-
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	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
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。

3、本基金合同生效日为 2023 年 04 月 07 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

#### 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 (%)
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国融证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
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 500 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 13 日
2	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 13 日
3	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 3 月 13 日
4	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 13 日
5	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》	证券时报	2023 年 3 月 13 日
6	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 13 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金新增招商证券股份有限公司为网下现金和网下股票发售代理机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 3 月 20 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金新增广发证券股份有限公司为网下现金发售代理机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 3 月 28 日
9	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额上网发售提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 3 月 29 日
10	《银华中证 500 价值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 3 月 31 日
11	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2023 年第 1 号)》	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
12	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 3 月 31 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 500 价值交易型开放式指数证	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2023 年 4 月 8 日

	券投资基金基金合同生效的公告》	网站, 证券时报	
14	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 13 日
15	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告》	证券时报	2023 年 4 月 13 日
16	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 4 月 13 日
17	《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2023 年 4 月 18 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于增加东北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, 上海证券报, 证券时报	2023 年 6 月 5 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	20230420-20230425	0.00	237,746,100.00	237,746,100.00	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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2023 年 3 月 31 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告》，本基金基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

2、本基金管理人于 2023 年 4 月 13 日披露了《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》，本基金自 2023 年 4 月 18 日起开放日常申购、赎回业务。

3、本基金管理人于 2023 年 4 月 13 日披露了《银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》，本基金自 2023 年 4 月 18 日在上海证券交易所上市交易。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华中证 500 价值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 500 价值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 500 价值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 500 价值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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

**银华基金管理股份有限公司**

**2023 年 8 月 29 日**