

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证  
券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	26
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>56</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>75</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4 基金投资策略的改变 .....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>83</b>
13.1 备查文件目录 .....	83
13.2 存放地点 .....	83
13.3 查阅方式 .....	83

## § 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	617,793,000.00 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	400-61-95555
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	400-61-95555	
传真	(010)58163027	0755-83195201	
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	100738	518040	
法定代表人	王珠林	缪建民	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) - 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-33,741,539.41	-55,600,469.89	-42,420,536.27
本期利润	-40,923,146.35	-102,999,637.43	-159,443,596.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0630	-0.1354	-0.1437
本期加权平均净值利润率	-8.53%	-17.79%	-15.63%
本期基金份额净值增长率	-9.21%	-14.72%	-13.05%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-201,902,424.46	-180,413,852.17	-110,001,319.60
期末可供分配基金份额利润	-0.3268	-0.2585	-0.1305
期末基金资产净值	415,890,575.54	517,379,147.83	732,791,680.40
期末基金份额净值	0.6732	0.7415	0.8695
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-32.68%	-25.85%	-13.05%

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

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

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

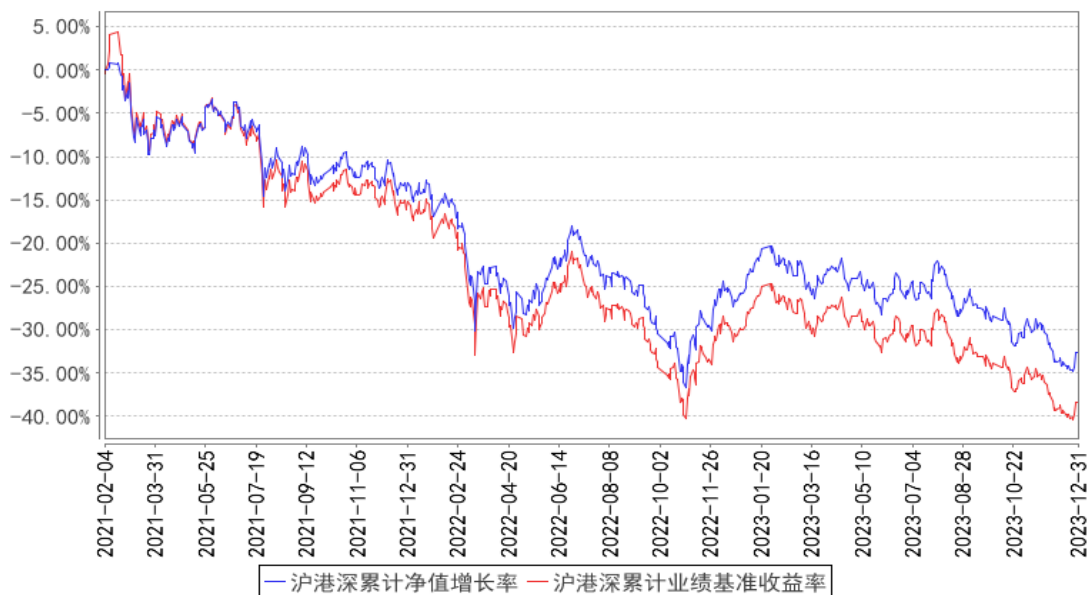
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.03%	0.88%	-6.84%	0.87%	0.81%	0.01%
过去六个月	-9.46%	0.91%	-11.17%	0.92%	1.71%	-0.01%
过去一年	-9.21%	0.89%	-11.97%	0.90%	2.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-32.68%	1.11%	-38.37%	1.16%	5.69%	-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

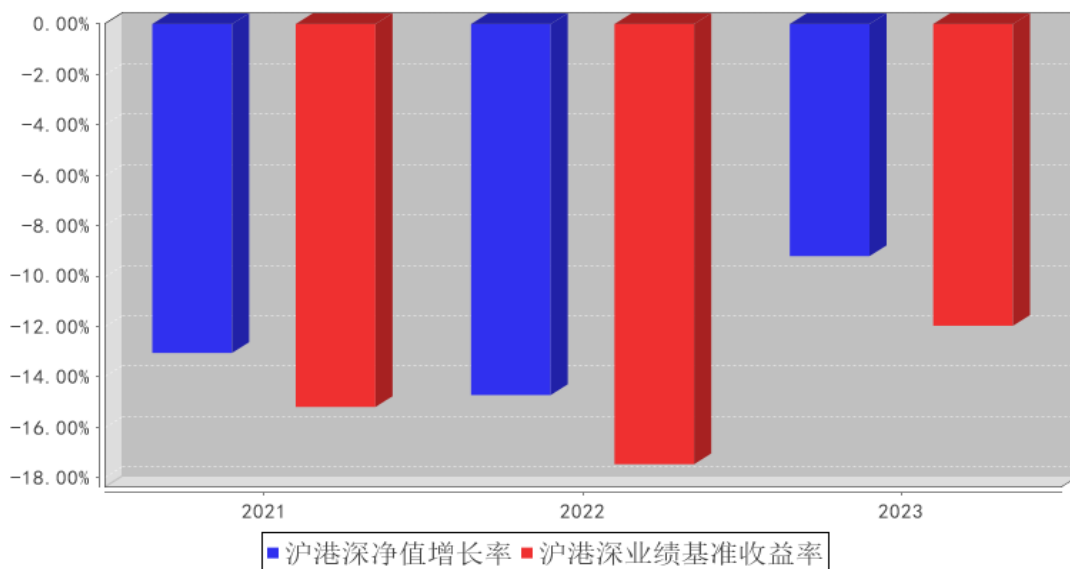
沪港深累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

沪港深基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2021年02月04日（基金合同生效日）至2021年12月31日止会计期间、2022年度及2023年度未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 197 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、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	11.5 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					<p>金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日至 2024 年 1 月 23 日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 日至 2024 年 1 月 23 日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基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证 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 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华沪深 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，自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 25 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联接基金基金经理，自 2024 年 3 月 6 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
李宜璇女士	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	10 年	<p>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</p>

					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	-	10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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从 T 检验(置信度为 95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 12 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

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6732 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.21%，业绩比较基准收益率为-11.97%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 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

2023 年，宏观经济逐渐从疫情中走出，从年初以来，整体呈现了从脉冲反弹到脉冲回落，最终缓慢复苏的运行特点。分经济部门来看，居民出行、居民消费等领域处于持续的复苏通道中，这在各个节假日的数据中体现明显；同时，商务活动尤其是与地产链条相关的商务活动，复苏进程仍然较弱，这在消费价位段、投融资结构等数据上有所显现。从海外来看，美联储在全年内以加息为主，使得外汇和国际资本流动都面临新的环境特点。这些外部因素在年末也正在迎来边际上的变化。在上述因素的作用下，A 股和港股市场主要指数在 2023 年表现不佳。

展望 2024 年我们认为，经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢且持续的过程；而随着新旧更替的深入，经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期，国内政策、汇率水平、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和和业务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27594 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“沪港深”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了沪港深 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于沪港深,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>沪港深的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估沪港深的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算沪港深、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督沪港深的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对沪港深持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致沪港深不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出</p>

	的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	23,230,373.19	28,414,618.75
结算备付金		4,883.86	13,878.30
存出保证金		7,296.65	11,972.36
交易性金融资产	7.4.7.2	393,059,339.32	489,464,640.56
其中：股票投资		393,059,339.32	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		22,969.54	17,381.66
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		416,324,862.56	517,922,491.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		33.84	43.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		174,243.82	221,563.95
应付托管费		34,848.76	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	7.4.7.9	225,160.60	277,423.60
负债合计		434,287.02	543,343.80
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	617,793,000.00	697,793,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-201,902,424.46	-180,413,852.17
净资产合计		415,890,575.54	517,379,147.83
负债和净资产总计		416,324,862.56	517,922,491.63

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6732 元，基金份额总额 617,793,000.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-37,811,195.77	-99,268,894.80
1. 利息收入		89,672.81	118,957.05
其中：存款利息收入	7.4.7.13	89,672.81	118,957.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-30,879,801.76	-52,222,233.37

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-43,099,713.89	-65,205,062.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	14,179.57
股利收益	7.4.7.19	12,219,912.13	12,968,649.37
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	-7,181,606.94	-47,399,167.54
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	160,540.12	233,549.06
<b>减：二、营业总支出</b>		3,111,950.58	3,730,742.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,404,125.11	2,908,381.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	480,824.93	581,676.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	51.18
8. 其他费用	7.4.7.23	227,000.54	240,633.45
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-40,923,146.35	-102,999,637.43
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-40,923,146.35	-102,999,637.43
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-40,923,146.35	-102,999,637.43

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	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)	-80,000,000.00	-	-21,488,572.29	-101,488,572.29
(一)、综合收益总额	-	-	-40,923,146.35	-40,923,146.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-80,000,000.00	-	19,434,574.06	-60,565,425.94
其中：1. 基金申购款	25,000,000.00	-	-6,114,967.29	18,885,032.71
2. 基金赎回款	-105,000,000.00	-	25,549,541.35	-79,450,458.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	617,793,000.00	-	-201,902,424.46	415,890,575.54
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计



一、上期期末净资产	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	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)	-145,000,000.00	-	-70,412,532.57	-215,412,532.57
(一)、综合收益总额	-	-	-102,999,637.43	-102,999,637.43
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-145,000,000.00	-	32,587,104.86	-112,412,895.14
其中：1. 基金申购款	55,000,000.00	-	-13,142,080.36	41,857,919.64
2. 基金赎回款	-200,000,000.00	-	45,729,185.22	-154,270,814.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	697,793,000.00	-	-180,413,852.17	517,379,147.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华中证沪港深 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。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处

于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估

值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税



[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023 年 12 月 31 日	
		上年度末
		2022 年 12 月 31 日
活期存款	23,230,373.19	28,414,618.75
等于：本金	23,227,902.11	28,411,524.88
加：应计利息	2,471.08	3,093.87
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	23,230,373.19	28,414,618.75

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		564,663,174.24	-	393,059,339.32	-171,603,834.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		564,663,174.24	-	393,059,339.32	-171,603,834.92
项目	上年度末				
	2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		653,886,868.54	-	489,464,640.56	-164,422,227.98
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	653,886,868.54	-	489,464,640.56	-164,422,227.98

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.8 其他资产

注：无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	15,160.60	57,423.60
其中：交易所市场	15,160.60	57,423.60
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	220,000.00
合计	225,160.60	277,423.60

## 7.4.7.10 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12月31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	25,000,000.00	25,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-105,000,000.00	-105,000,000.00
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	617,793,000.00	617,793,000.00

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-79,609,970.29	-100,803,881.88	-180,413,852.17
本期利润	-33,741,539.41	-7,181,606.94	-40,923,146.35
本期基金份额交易产生的变动数	10,651,380.16	8,783,193.90	19,434,574.06
其中：基金申购款	-3,319,637.05	-2,795,330.24	-6,114,967.29
金赎回款	13,971,017.21	11,578,524.14	25,549,541.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-102,700,129.54	-99,202,294.92	-201,902,424.46

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	84,510.61	114,121.63
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	4,960.67	4,398.59
其他	201.53	436.83
合计	89,672.81	118,957.05

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-37,504,990.18	-54,572,515.11
股票投资收益——赎回差价收入	-5,594,723.71	-10,632,547.20
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	-43,099,713.89	-65,205,062.31

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	98,785,676.30	158,130,149.60
减：卖出股票成本总额	136,036,707.32	212,225,600.74
减：交易费用	253,959.16	477,063.97
买卖股票差价收入	-37,504,990.18	-54,572,515.11

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

赎回基金份额对价总额	79,450,458.65	154,270,814.78
减：现金支付赎回款总额	52,059,074.65	100,471,886.78
减：赎回股票成本总额	32,986,107.71	64,431,475.20
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-5,594,723.71	-10,632,547.20

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出权证成交总额	-	14,642.73
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	-	36.68
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	426.48
买卖权证差价收入	-	14,179.57

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,219,912.13	12,968,649.37
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	12,219,912.13	12,968,649.37

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,181,606.94	-47,399,167.54
股票投资	-7,181,606.94	-47,399,167.54



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	-7,181,606.94	-47,399,167.54

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	160,540.12	233,549.06
合计	160,540.12	233,549.06

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	90,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,287.13	3,401.79
其他	14,713.41	17,231.66
合计	227,000.54	240,633.45

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人的股东
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司(“银华基金”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司

注：1、根据银华基金管理股份有限公司于 2023 年 9 月 27 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会同意，银华基金管理股份有限公司已受让银华长安资本管理（北京）有限公司持有的深圳银华永泰创新投资有限公司全部股权，深圳银华永泰创新投资有限公司已变更为银华基金管理股份有限公司的全资子公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,404,125.11	2,908,381.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,922.74	29,564.17
应支付基金管理人的净管理费	2,371,202.37	2,878,817.44

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	480,824.93	581,676.39

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	23,230,373.19	84,510.61	28,414,618.75	114,121.63

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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）156,700.00 股，期末公允价值为人民币 4,359,394.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.05%；招商银行（代码 03968）58,000.00 股，期末公允价值为人民币 1,429,652.67 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.34%。

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）45,000.00 股，期末公允价值为人民币 342,000.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.08%。

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）59,200.00 股，期末公允价值为人民币 800,976.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.19%。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	631	24,060.03	17,895.16	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	286	15,924.48	10,747.88	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301418	协昌	2023年8月	6个月	新股流通	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

	科技	10日		受限						
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	457	21,744.06	13,810.54	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	380	15,196.20	14,747.80	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	599	16,772.00	13,579.33	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301518	长华	2023年7月	6个月	新股流通	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-

	化学	26 日		受限							
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	504	12,206.88	9,192.96	-	
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	107	6,214.56	6,185.67	-	
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-	
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	186	15,028.80	14,461.50	-	
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,849	18,249.63	23,574.75	-	
688563	航材	2023 年 7 月	6 个月	新股流通	78.99	60.49	340	26,856.60	20,566.60	-	

	股份	12 日		受限						
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	666	16,636.68	18,661.32	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。



#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	23,230,373.19	-	-	-	23,230,373.19
结算备付金	4,883.86	-	-	-	4,883.86

存出保证金	7,296.65	-	-	-	7,296.65
交易性金融资产	-	-	-	-393,059,339.32	393,059,339.32
应收股利	-	-	-	22,969.54	22,969.54
资产总计	23,242,553.70	-	-	-393,082,308.86	416,324,862.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	174,243.82	174,243.82
应付托管费	-	-	-	34,848.76	34,848.76
应付清算款	-	-	-	33.84	33.84
其他负债	-	-	-	225,160.60	225,160.60
负债总计	-	-	-	434,287.02	434,287.02
利率敏感度缺口	23,242,553.70	-	-	-392,648,021.84	415,890,575.54
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					
货币资金	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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末（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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	153,895,920.22	-	153,895,920.22
资产合计	-	153,895,920.22	-	153,895,920.22
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	153,895,920.22	-	153,895,920.22
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	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 外汇风险敞口净额	-	198,403,228.34	-	198,403,228.34

#### 7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币-5%	-7,694,796.01	-9,920,161.42

	港币 5%	7,694,796.01	9,920,161.42
--	-------	--------------	--------------

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	393,059,339.32	94.51	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	393,059,339.32	94.51	489,464,640.56	94.60

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相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12月31日）	上年度末（2022年12月）

			31 日 )
	业绩比较基准上升 5%	20,359,597.86	24,972,445.09
	业绩比较基准下降 5%	-20,359,597.86	-24,972,445.09

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	392,579,565.11	487,327,209.61
第二层次	-	509,130.70
第三层次	479,774.21	1,628,300.25
合计	393,059,339.32	489,464,640.56

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,628,300.25	1,628,300.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,052,182.75	2,052,182.75
转出第三层次	-	1,914,546.57	1,914,546.57
当期利得或损失总额	-	-1,286,162.22	-1,286,162.22
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,286,162.22	-1,286,162.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	479,774.21	479,774.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	22,076.55	22,076.55
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,172,487.10	1,172,487.10
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,496,158.51	1,496,158.51
转出第三层次	-	1,172,487.10	1,172,487.10
当期利得或损失总额	-	132,141.74	132,141.74
其中：计入损益的利得或损失	-	132,141.74	132,141.74
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,628,300.25	1,628,300.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	132,141.74	132,141.74

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金购买第三层次交易性金融资产及第三层次转入/转出的交易性金融资产均为限售股票投资及限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	479,774.21	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
长期停牌股票	65,798.27	市场法	市盈率	1.50	正相关
锁定期股票	1,562,501.98	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	26.35%-247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	393,059,339.32	94.41



	其中：股票	393,059,339.32	94.41
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	23,235,257.05	5.58
8	其他各项资产	30,266.19	0.01
9	合计	416,324,862.56	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 153,895,920.22 元，占期末净值比例为 37.00%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,774,866.00	0.67
B	采矿业	10,497,607.50	2.52
C	制造业	134,077,724.10	32.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,603,720.00	1.83
E	建筑业	4,539,759.40	1.09
F	批发和零售业	951,723.04	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	7,235,051.60	1.74
H	住宿和餐饮业	173,420.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,572,366.73	2.78
J	金融业	49,483,140.72	11.90
K	房地产业	3,058,634.00	0.74
L	租赁和商务服务业	1,847,348.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	2,880,861.10	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	105,600.00	0.03
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,374,522.96	0.33
R	文化、体育和娱乐业	499,968.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	238,676,313.15	57.39

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	459,130.29	0.11
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	7,901.23	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	6,947.14	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
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	487,105.95	0.12

### 8.2.3 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	1,029,733.25	0.25
消费者非必需品	21,067,909.49	5.07
消费者常用品	6,845,399.19	1.65
能源	6,513,197.97	1.57
金融	53,632,043.00	12.90

医疗保健	5,798,891.82	1.39
工业	6,073,993.92	1.46
信息技术	7,503,533.32	1.80
电信服务	32,055,746.35	7.71
公用事业	5,407,342.25	1.30
地产建筑业	7,968,129.66	1.92
合计	153,895,920.22	37.00

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	84,300	22,429,379.99	5.39
2	00005	汇丰控股	244,800	13,976,087.33	3.36
3	600519	贵州茅台	8,000	13,808,000.00	3.32
4	01299	友邦保险	144,400	8,904,898.33	2.14
5	601318	中国平安	136,300	5,492,890.00	1.32
5	02318	中国平安	94,500	3,027,295.88	0.73
6	00941	中国移动	103,500	6,077,836.30	1.46
6	600941	中国移动	11,400	1,134,072.00	0.27
7	00939	建设银行	1,522,000	6,413,590.81	1.54
7	601939	建设银行	85,300	555,303.00	0.13
8	01398	工商银行	1,099,000	3,804,474.68	0.91
8	601398	工商银行	444,000	2,122,320.00	0.51
9	03690	美团-W	79,020	5,864,818.41	1.41
10	600036	招商银行	156,700	4,359,394.00	1.05
10	03968	招商银行	58,000	1,429,652.67	0.34
11	300750	宁德时代	33,391	5,451,414.66	1.31
12	01211	比亚迪股份	14,000	2,720,109.95	0.65
12	002594	比亚迪	11,500	2,277,000.00	0.55
13	03988	中国银行	1,059,000	2,859,867.20	0.69
13	601988	中国银行	267,000	1,065,330.00	0.26
14	00388	香港交易所	16,100	3,910,158.06	0.94
15	000858	五粮液	24,532	3,442,084.92	0.83
16	601899	紫金矿业	208,500	2,597,910.00	0.62
16	02899	紫金矿业	72,000	829,952.52	0.20
17	000333	美的集团	62,200	3,397,986.00	0.82
18	00883	中国海洋石油	226,000	2,662,474.36	0.64
18	600938	中国海油	26,600	557,802.00	0.13
19	01810	小米集团-W	222,200	3,141,248.51	0.76
20	601166	兴业银行	184,200	2,985,882.00	0.72
21	601328	交通银行	348,100	1,998,094.00	0.48

21	03328	交通银行	222,000	979,750.69	0.24
22	600030	中信证券	123,510	2,515,898.70	0.60
22	06030	中信证券	26,500	382,796.39	0.09
23	600900	长江电力	124,000	2,894,160.00	0.70
24	600276	恒瑞医药	56,540	2,557,304.20	0.61
25	601288	农业银行	404,100	1,470,924.00	0.35
25	01288	农业银行	389,000	1,061,083.94	0.26
26	600028	中国石化	241,100	1,345,338.00	0.32
26	00386	中国石油化工股份	314,000	1,163,822.10	0.28
27	688981	中芯国际	24,975	1,324,174.50	0.32
27	00981	中芯国际	60,500	1,088,850.52	0.26
28	601088	中国神华	41,700	1,307,295.00	0.31
28	01088	中国神华	42,500	1,030,258.86	0.25
29	00857	中国石油股份	268,000	1,253,193.51	0.30
29	601857	中国石油	143,600	1,013,816.00	0.24
30	300059	东方财富	160,699	2,256,213.96	0.54
31	300760	迈瑞医疗	7,700	2,237,620.00	0.54
32	002475	立讯精密	63,400	2,184,130.00	0.53
33	600887	伊利股份	80,500	2,153,375.00	0.52
34	02015	理想汽车-W	16,100	2,146,209.89	0.52
35	09633	农夫山泉	51,000	2,086,707.48	0.50
36	02888	渣打集团	33,750	1,998,724.85	0.48
37	00669	创科实业	23,000	1,939,446.73	0.47
38	603259	药明康德	25,960	1,888,849.60	0.45
39	01024	快手-W	38,700	1,856,994.31	0.45
40	000725	京东方 A	474,700	1,851,330.00	0.45
41	600309	万华化学	23,900	1,835,998.00	0.44
42	000651	格力电器	57,000	1,833,690.00	0.44
43	601012	隆基绿能	76,660	1,755,514.00	0.42
44	600690	海尔智家	48,000	1,008,000.00	0.24
44	06690	海尔智家	36,000	719,357.44	0.17
45	300124	汇川技术	27,050	1,707,937.00	0.41
46	00016	新鸿基地产	22,000	1,683,666.14	0.40
47	000568	泸州老窖	9,300	1,668,606.00	0.40
48	601728	中国电信	196,400	1,062,524.00	0.26
48	00728	中国电信	176,000	596,510.25	0.14
49	002415	海康威视	47,300	1,642,256.00	0.39
50	06160	百济神州	15,700	1,566,464.71	0.38
51	600919	江苏银行	232,400	1,554,756.00	0.37
52	09987	百胜中国	5,150	1,550,388.36	0.37
53	601601	中国太保	43,400	1,032,052.00	0.25
53	02601	中国太保	35,200	502,727.36	0.12
54	601816	京沪高铁	311,100	1,530,612.00	0.37

55	00002	中电控股	25,500	1,489,349.91	0.36
56	02628	中国人寿	94,000	862,068.96	0.21
56	601628	中国人寿	21,000	595,350.00	0.14
57	02269	药明生物	54,000	1,448,502.05	0.35
58	002714	牧原股份	34,600	1,424,828.00	0.34
59	600809	山西汾酒	6,160	1,421,296.80	0.34
60	300498	温氏股份	67,300	1,350,038.00	0.32
61	00027	银河娱乐	33,000	1,308,355.13	0.31
62	00001	长和	34,000	1,289,460.44	0.31
63	601668	中国建筑	265,700	1,278,017.00	0.31
64	002352	顺丰控股	31,000	1,252,400.00	0.30
65	02020	安踏体育	18,000	1,235,630.97	0.30
66	600016	民生银行	313,900	1,173,986.00	0.28
67	01109	华润置地	46,000	1,167,211.36	0.28
68	300274	阳光电源	13,200	1,156,188.00	0.28
69	000001	平安银行	122,700	1,152,153.00	0.28
70	600837	海通证券	122,100	1,144,077.00	0.28
71	600406	国电南瑞	50,975	1,137,762.00	0.27
72	601658	邮储银行	140,700	612,045.00	0.15
72	01658	邮储银行	151,000	510,410.29	0.12
73	000792	盐湖股份	68,700	1,095,765.00	0.26
74	002230	科大讯飞	23,500	1,089,930.00	0.26
75	000063	中兴通讯	40,300	1,067,144.00	0.26
76	000625	长安汽车	62,884	1,058,337.72	0.25
77	600050	中国联通	241,500	1,057,770.00	0.25
78	601888	中国中免	12,400	1,037,756.00	0.25
79	600031	三一重工	75,300	1,036,881.00	0.25
80	02388	中银香港	53,500	1,027,834.72	0.25
81	601225	陕西煤业	49,000	1,023,610.00	0.25
82	000100	TCL 科技	237,480	1,021,164.00	0.25
83	002142	宁波银行	50,190	1,009,320.90	0.24
84	603501	韦尔股份	9,270	989,201.70	0.24
85	600000	浦发银行	148,400	982,408.00	0.24
86	01113	长实集团	27,000	959,143.25	0.23
87	000338	潍柴动力	68,600	936,390.00	0.23
88	300015	爱尔眼科	59,028	933,822.96	0.22
89	300122	智飞生物	15,250	931,927.50	0.22
90	688111	金山办公	2,922	923,936.40	0.22
91	600436	片仔癀	3,800	919,562.00	0.22
92	300308	中际旭创	8,100	914,571.00	0.22
93	601688	华泰证券	65,100	908,145.00	0.22
94	600048	保利发展	91,000	900,900.00	0.22
95	000002	万科 A	86,100	900,606.00	0.22

96	601985	中国核电	119,800	898,500.00	0.22
97	600089	特变电工	64,060	884,028.00	0.21
98	09868	小鹏汽车-W	16,700	858,090.66	0.21
99	600438	通威股份	34,200	856,026.00	0.21
100	601211	国泰君安	57,200	851,136.00	0.20
101	601169	北京银行	187,400	848,922.00	0.20
102	01928	金沙中国有限公司	40,800	844,850.78	0.20
103	688041	海光信息	11,794	837,138.12	0.20
104	002371	北方华创	3,400	835,414.00	0.20
105	002304	洋河股份	7,600	835,240.00	0.20
106	600150	中国船舶	28,300	833,152.00	0.20
107	002050	三花智控	28,300	832,020.00	0.20
108	02313	申洲国际	11,400	830,605.00	0.20
109	688012	中微公司	5,383	826,828.80	0.20
110	002027	分众传媒	128,100	809,592.00	0.19
111	601766	中国中车	153,800	808,988.00	0.19
112	603288	海天味业	21,161	803,059.95	0.19
113	600104	上汽集团	59,200	800,976.00	0.19
114	00011	恒生银行	9,700	800,359.91	0.19
115	01801	信达生物	20,500	794,188.55	0.19
116	600905	三峡能源	181,200	791,844.00	0.19
117	01093	石药集团	120,000	789,498.86	0.19
118	603986	兆易创新	8,480	783,467.20	0.19
119	00006	电能实业	19,000	779,122.65	0.19
120	00267	中信股份	110,000	777,536.76	0.19
121	601919	中远海控	80,670	772,818.60	0.19
122	00003	香港中华煤气	141,950	769,254.82	0.18
123	02319	蒙牛乳业	40,000	761,224.80	0.18
124	601138	工业富联	50,300	760,536.00	0.18
125	600660	福耀玻璃	20,300	759,017.00	0.18
126	00992	联想集团	76,000	752,090.10	0.18
127	601229	上海银行	125,784	750,930.48	0.18
128	01171	兖矿能源	30,000	403,449.14	0.10
128	600188	兖矿能源	17,450	345,684.50	0.08
129	02328	中国财险	88,000	740,055.50	0.18
130	601390	中国中铁	130,100	738,968.00	0.18
131	002466	天齐锂业	13,100	730,849.00	0.18
132	00168	青岛啤酒股份	8,000	379,887.42	0.09
132	600600	青岛啤酒	4,500	336,375.00	0.08
133	688271	联影医疗	5,205	713,137.05	0.17
134	00688	中国海外发展	55,500	692,062.09	0.17
135	600585	海螺水泥	30,300	683,568.00	0.16
136	601818	光大银行	234,700	680,630.00	0.16

137	688008	澜起科技	11,502	675,857.52	0.16
138	600019	宝钢股份	112,000	664,160.00	0.16
139	300782	卓胜微	4,684	660,444.00	0.16
140	300014	亿纬锂能	15,500	654,100.00	0.16
141	00066	港铁公司	23,500	645,273.95	0.16
142	00998	中信银行	132,000	440,205.43	0.11
142	601998	中信银行	38,600	204,194.00	0.05
143	600999	招商证券	47,000	641,080.00	0.15
144	002129	TCL 中环	40,875	639,285.00	0.15
145	002241	歌尔股份	30,300	636,603.00	0.15
146	600893	航发动力	16,900	631,722.00	0.15
147	02331	李宁	33,000	625,019.93	0.15
148	02382	舜宇光学科技	9,700	622,795.16	0.15
149	600111	北方稀土	32,100	620,814.00	0.15
150	00291	华润啤酒	20,000	619,854.48	0.15
151	002460	赣锋锂业	14,280	611,184.00	0.15
152	000661	长春高新	4,100	597,780.00	0.14
153	601989	中国重工	144,500	596,785.00	0.14
154	00175	吉利汽车	76,000	591,616.66	0.14
155	600760	中航沈飞	13,941	588,031.38	0.14
156	603019	中科曙光	14,800	584,452.00	0.14
157	002049	紫光国微	8,640	582,768.00	0.14
158	600958	东方证券	66,420	577,854.00	0.14
159	06618	京东健康	16,150	572,246.21	0.14
160	603799	华友钴业	17,290	569,359.70	0.14
161	601600	中国铝业	100,600	567,384.00	0.14
162	601006	大秦铁路	78,100	563,101.00	0.14
163	000938	紫光股份	29,000	561,150.00	0.13
164	688036	传音控股	4,054	561,073.60	0.13
165	000538	云南白药	11,320	556,378.00	0.13
166	600570	恒生电子	19,312	555,413.12	0.13
167	01997	九龙仓置业	23,000	550,256.78	0.13
168	600584	长电科技	18,100	540,466.00	0.13
169	002252	上海莱士	67,100	536,800.00	0.13
170	000776	广发证券	37,500	535,875.00	0.13
171	601669	中国电建	108,900	532,521.00	0.13
172	600547	山东黄金	22,900	523,723.00	0.13
173	002179	中航光电	13,422	523,458.00	0.13
174	02688	新奥能源	10,000	521,076.50	0.13
175	600426	华鲁恒升	18,860	520,347.40	0.13
176	00288	万洲国际	113,500	518,394.09	0.12
177	600009	上海机场	15,800	517,924.00	0.12
178	601377	兴业证券	87,410	513,096.70	0.12

179	000166	申万宏源	113,800	505,272.00	0.12
180	300408	三环集团	17,000	500,650.00	0.12
181	600886	国投电力	37,600	495,568.00	0.12
182	000425	徐工机械	89,800	490,308.00	0.12
183	002271	东方雨虹	25,500	489,600.00	0.12
184	000596	古井贡酒	2,100	488,880.00	0.12
185	601009	南京银行	65,700	484,866.00	0.12
186	601916	浙商银行	190,340	479,656.80	0.12
187	300142	沃森生物	20,400	479,604.00	0.12
188	002311	海大集团	10,500	471,555.00	0.11
189	600795	国电电力	112,500	468,000.00	0.11
190	600085	同仁堂	8,700	467,190.00	0.11
191	600745	闻泰科技	11,000	465,410.00	0.11
192	603993	洛阳钼业	89,200	463,840.00	0.11
193	000963	华东医药	11,100	460,206.00	0.11
194	600588	用友网络	25,836	459,622.44	0.11
195	002236	大华股份	24,900	459,405.00	0.11
196	002920	德赛西威	3,500	453,285.00	0.11
197	600015	华夏银行	80,300	451,286.00	0.11
198	600926	杭州银行	44,900	449,449.00	0.11
199	600845	宝信软件	9,174	447,691.20	0.11
200	01177	中国生物制药	142,000	446,530.84	0.11
201	601186	中国铁建	58,300	443,663.00	0.11
202	00788	中国铁塔	592,000	439,915.44	0.11
203	001979	招商蛇口	46,000	438,380.00	0.11
204	002459	晶澳科技	21,084	436,860.48	0.11
205	000977	浪潮信息	13,100	434,920.00	0.10
206	601111	中国国航	59,100	433,794.00	0.10
207	600522	中天科技	34,700	433,403.00	0.10
208	00322	康师傅控股	50,000	431,360.72	0.10
209	600011	华能国际	55,700	428,890.00	0.10
210	600674	川投能源	28,100	424,872.00	0.10
211	300033	同花顺	2,700	423,549.00	0.10
212	601995	中金公司	11,100	422,355.00	0.10
213	601901	方正证券	52,300	421,538.00	0.10
214	600115	中国东航	108,500	420,980.00	0.10
215	600010	包钢股份	288,200	420,772.00	0.10
216	002812	恩捷股份	7,400	420,468.00	0.10
217	00083	信和置业	54,000	415,465.62	0.10
218	300896	爱美客	1,400	412,062.00	0.10
219	601689	拓普集团	5,600	411,600.00	0.10
220	000157	中联重科	62,800	410,084.00	0.10
221	600989	宝丰能源	27,700	409,129.00	0.10



222	601360	三六零	45,300	408,153.00	0.10
223	600196	复星医药	16,100	402,983.00	0.10
224	01929	周大福	38,000	400,150.50	0.10
225	002493	荣盛石化	38,350	396,922.50	0.10
226	600029	南方航空	68,500	394,560.00	0.09
227	000768	中航西飞	17,600	393,712.00	0.09
228	601633	长城汽车	15,600	393,432.00	0.09
229	688599	天合光能	13,755	392,430.15	0.09
230	00012	恒基地产	18,000	392,302.64	0.09
231	603369	今世缘	8,000	390,000.00	0.09
232	002602	世纪华通	75,300	388,548.00	0.09
233	601066	中信建投	16,400	388,024.00	0.09
234	00285	比亚迪电子	11,500	381,428.00	0.09
235	601788	光大证券	24,700	380,874.00	0.09
236	00960	龙湖集团	33,500	379,479.63	0.09
237	300496	中科创达	4,700	376,282.00	0.09
238	01821	ESR	38,400	375,827.56	0.09
239	300661	圣邦股份	4,187	372,684.87	0.09
240	601555	东吴证券	50,978	372,649.18	0.09
241	01038	长江基建集团	9,500	371,912.69	0.09
242	601100	恒立液压	6,800	371,824.00	0.09
243	06862	海底捞	28,000	368,940.29	0.09
244	002555	三七互娱	19,600	368,676.00	0.09
245	600489	中金黄金	36,900	367,524.00	0.09
246	002709	天赐材料	14,600	366,168.00	0.09
247	300316	晶盛机电	8,300	365,947.00	0.09
248	603392	万泰生物	4,863	365,357.19	0.09
249	00004	九龙仓集团	16,000	364,662.93	0.09
250	300347	泰格医药	6,600	362,802.00	0.09
251	688126	沪硅产业	20,893	361,866.76	0.09
252	002601	龙佰集团	21,100	361,443.00	0.09
253	00268	金蝶国际	35,000	360,947.43	0.09
254	688256	寒武纪	2,648	357,374.08	0.09
255	00135	昆仑能源	56,000	357,268.17	0.09
256	300450	先导智能	13,880	355,328.00	0.09
257	002340	格林美	64,800	353,808.00	0.09
258	600346	恒力石化	26,800	352,956.00	0.08
259	601825	沪农商行	61,100	350,714.00	0.08
260	002821	凯莱英	3,020	350,622.00	0.08
261	000895	双汇发展	13,100	349,901.00	0.08
262	00762	中国联通	78,000	346,357.28	0.08
263	601868	中国能建	164,200	344,820.00	0.08
264	601800	中国交建	45,000	342,000.00	0.08

265	00836	华润电力	24,000	340,158.74	0.08
266	002001	新和成	19,700	334,112.00	0.08
267	300433	蓝思科技	25,300	333,960.00	0.08
268	601699	潞安环能	15,200	333,032.00	0.08
269	00019	太古股份公司 A	5,500	329,456.28	0.08
270	600741	华域汽车	20,100	327,228.00	0.08
271	601336	新华保险	10,500	326,865.00	0.08
272	300759	康龙化成	11,275	326,749.50	0.08
273	601233	桐昆股份	21,400	323,782.00	0.08
274	600161	天坛生物	10,400	321,776.00	0.08
275	600372	中航机载	24,346	320,880.28	0.08
276	00151	中国旺旺	75,000	320,801.88	0.08
277	601108	财通证券	41,340	320,798.40	0.08
278	600515	海南机场	86,700	320,790.00	0.08
279	000301	东方盛虹	33,400	320,640.00	0.08
280	000807	云铝股份	26,200	320,164.00	0.08
281	601077	渝农商行	78,300	319,464.00	0.08
282	688777	中控技术	6,939	314,683.65	0.08
283	002384	东山精密	17,300	314,514.00	0.08
284	002648	卫星化学	21,232	313,172.00	0.08
285	300832	新产业	4,000	312,800.00	0.08
286	300037	新宙邦	6,600	312,180.00	0.08
287	601881	中国银河	25,900	312,095.00	0.08
288	688122	西部超导	5,848	311,289.04	0.07
289	601021	春秋航空	6,200	311,240.00	0.07
290	002736	国信证券	36,300	310,002.00	0.07
291	003816	中国广核	99,600	309,756.00	0.07
292	09626	哔哩哔哩-W	3,640	308,752.78	0.07
293	03800	协鑫科技	273,000	306,773.59	0.07
294	002007	华兰生物	13,800	305,394.00	0.07
295	300012	华测检测	21,300	302,460.00	0.07
296	00868	信义玻璃	38,000	301,662.51	0.07
297	03888	金山软件	13,800	301,390.65	0.07
298	000786	北新建材	12,900	301,344.00	0.07
299	603605	珀莱雅	3,000	298,200.00	0.07
300	600176	中国巨石	30,294	297,790.02	0.07
301	601117	中国化学	46,300	294,468.00	0.07
302	688396	华润微	6,587	294,373.03	0.07
303	600885	宏发股份	10,620	293,536.80	0.07
304	002074	国轩高科	13,600	292,400.00	0.07
305	601877	正泰电器	13,500	290,385.00	0.07
306	00384	中国燃气	41,400	289,259.99	0.07
307	002410	广联达	16,840	288,637.60	0.07

308	601615	明阳智能	23,000	288,420.00	0.07
309	000733	振华科技	4,900	288,316.00	0.07
310	01548	金斯瑞生物科技	16,000	287,960.47	0.07
311	01876	百威亚太	21,700	287,501.92	0.07
312	301269	华大九天	2,700	285,795.00	0.07
313	000983	山西焦煤	28,800	284,544.00	0.07
314	002625	光启技术	19,200	283,776.00	0.07
315	002180	纳思达	12,500	282,875.00	0.07
316	00968	信义光能	68,000	281,000.70	0.07
317	600702	舍得酒业	2,900	280,430.00	0.07
318	600160	巨化股份	17,000	280,330.00	0.07
319	002202	金风科技	34,800	278,400.00	0.07
320	601618	中国中冶	90,700	277,542.00	0.07
321	300207	欣旺达	18,800	277,488.00	0.07
322	688072	拓荆科技	1,185	274,090.50	0.07
323	01193	华润燃气	11,800	273,750.94	0.07
324	601838	成都银行	24,300	273,618.00	0.07
325	600183	生益科技	14,900	272,819.00	0.07
326	603345	安井食品	2,600	271,986.00	0.07
327	600298	安琪酵母	7,700	270,886.00	0.07
328	300003	乐普医疗	16,600	268,256.00	0.06
329	600233	圆通速递	21,800	267,922.00	0.06
330	000876	新希望	28,700	267,484.00	0.06
331	00020	商汤-W	254,000	267,008.66	0.06
332	601727	上海电气	63,900	266,463.00	0.06
333	688099	晶晨股份	4,248	266,052.24	0.06
334	000783	长江证券	49,000	263,620.00	0.06
335	00241	阿里健康	68,000	261,281.35	0.06
336	600219	南山铝业	88,800	261,072.00	0.06
337	300144	宋城演艺	26,400	260,568.00	0.06
338	603939	益丰药房	6,426	257,297.04	0.06
339	000723	美锦能源	38,500	256,410.00	0.06
340	601878	浙商证券	24,500	255,535.00	0.06
341	600332	白云山	8,900	254,540.00	0.06
342	600096	云天化	16,300	254,280.00	0.06
343	000408	藏格矿业	10,000	253,400.00	0.06
344	300999	金龙鱼	7,500	250,350.00	0.06
345	600765	中航重机	13,100	250,341.00	0.06
346	01044	恒安国际	9,500	250,094.06	0.06
347	002756	永兴材料	4,770	249,041.70	0.06
348	000999	华润三九	5,000	248,650.00	0.06
349	002385	大北农	41,600	247,936.00	0.06
350	601238	广汽集团	28,200	246,750.00	0.06

351	000066	中国长城	24,300	245,916.00	0.06
352	002603	以岭药业	10,600	244,542.00	0.06
353	600732	爱旭股份	13,800	243,432.00	0.06
354	002841	视源股份	5,300	242,528.00	0.06
355	600918	中泰证券	35,300	242,158.00	0.06
356	002600	领益智造	35,800	242,008.00	0.06
357	688180	君实生物	5,783	241,902.89	0.06
358	601872	招商轮船	41,000	241,080.00	0.06
359	688303	大全能源	8,149	240,965.93	0.06
360	600460	士兰微	10,500	239,715.00	0.06
361	300413	芒果超媒	9,500	239,400.00	0.06
362	300223	北京君正	3,700	239,205.00	0.06
363	01066	威高股份	34,400	237,233.90	0.06
364	601799	星宇股份	1,800	235,998.00	0.06
365	600362	江西铜业	13,200	235,752.00	0.06
366	300751	迈为股份	1,820	235,708.20	0.06
367	600023	浙能电力	51,100	235,571.00	0.06
368	601607	上海医药	14,000	234,220.00	0.06
369	300601	康泰生物	8,540	231,861.00	0.06
370	300454	深信服	3,200	231,328.00	0.06
371	603806	福斯特	9,484	230,176.68	0.06
372	603260	合盛硅业	4,500	229,500.00	0.06
373	03692	翰森制药	16,000	228,512.44	0.05
374	603659	璞泰来	10,846	227,006.78	0.05
375	00101	恒隆地产	23,000	226,772.49	0.05
376	688047	龙芯中科	2,033	224,870.13	0.05
377	601898	中煤能源	23,100	223,839.00	0.05
378	688223	晶科能源	25,223	223,475.78	0.05
379	600027	华电国际	43,300	222,562.00	0.05
380	603606	东方电缆	5,200	222,300.00	0.05
381	600763	通策医疗	2,900	221,705.00	0.05
382	02618	京东物流	25,000	221,570.79	0.05
383	300146	汤臣倍健	13,000	221,390.00	0.05
384	06186	中国飞鹤	57,000	220,564.89	0.05
385	600061	国投资本	32,700	220,398.00	0.05
386	603882	金域医学	3,500	218,995.00	0.05
387	603816	顾家家居	6,230	218,050.00	0.05
388	601696	中银证券	21,100	217,119.00	0.05
389	01209	华润万象生活	8,600	217,048.75	0.05
390	300763	锦浪科技	3,100	216,690.00	0.05
391	00270	粤海投资	42,000	216,187.84	0.05
392	600026	中远海能	17,600	215,424.00	0.05
393	06110	滔搏	39,000	214,882.89	0.05

394	01972	太古地产	15,000	214,774.14	0.05
395	03311	中国建筑国际	26,000	212,762.33	0.05
396	000799	酒鬼酒	2,900	212,135.00	0.05
397	00144	招商局港口	22,000	212,127.98	0.05
398	00017	新世界发展	19,000	208,684.34	0.05
399	603589	口子窖	4,600	208,380.00	0.05
400	01308	海丰国际	17,000	207,669.38	0.05
401	300919	中伟股份	4,200	206,346.00	0.05
402	600132	重庆啤酒	3,100	205,995.00	0.05
403	600875	东方电气	14,000	204,680.00	0.05
404	688728	格科微	9,951	203,696.97	0.05
405	00881	中升控股	12,000	203,138.28	0.05
406	603688	石英股份	2,300	199,824.00	0.05
407	01378	中国宏桥	34,500	199,780.73	0.05
408	603290	斯达半导	1,100	199,100.00	0.05
409	01585	雅迪控股	16,000	198,933.41	0.05
410	603198	迎驾贡酒	3,000	198,870.00	0.05
411	600803	新奥股份	11,800	198,476.00	0.05
412	002938	鹏鼎控股	8,800	196,416.00	0.05
413	600025	华能水电	22,700	195,901.00	0.05
414	601319	中国人保	40,100	194,084.00	0.05
415	000629	钒钛股份	59,100	193,848.00	0.05
416	000069	华侨城 A	62,300	193,753.00	0.05
417	600884	杉杉股份	14,200	193,404.00	0.05
418	601865	福莱特	7,200	192,240.00	0.05
419	300390	天华新能	7,420	188,097.00	0.05
420	605117	德业股份	2,240	187,936.00	0.05
421	300628	亿联网络	6,340	187,347.00	0.05
422	002240	盛新锂能	8,200	186,550.00	0.04
423	002916	深南电路	2,600	184,574.00	0.04
424	605499	东鹏饮料	1,000	182,510.00	0.04
425	000708	中信特钢	12,800	179,712.00	0.04
426	601966	玲珑轮胎	9,300	178,839.00	0.04
427	03998	波司登	56,000	178,126.60	0.04
428	603899	晨光股份	4,700	176,485.00	0.04
429	600383	金地集团	40,200	175,272.00	0.04
430	600018	上港集团	35,600	174,440.00	0.04
431	000617	中油资本	32,200	173,880.00	0.04
432	600754	锦江酒店	5,800	173,420.00	0.04
433	300769	德方纳米	2,820	172,104.60	0.04
434	002064	华峰化学	25,400	170,434.00	0.04
435	002939	长城证券	20,700	165,600.00	0.04
436	300442	润泽科技	6,500	164,905.00	0.04

437	600039	四川路桥	21,960	164,480.40	0.04
438	002568	百润股份	6,640	163,410.40	0.04
439	603195	公牛集团	1,700	162,605.00	0.04
440	603833	欧派家居	2,300	160,103.00	0.04
441	688363	华熙生物	2,378	159,159.54	0.04
442	601216	君正集团	42,400	158,576.00	0.04
443	002414	高德红外	21,705	158,446.50	0.04
444	600563	法拉电子	1,700	157,420.00	0.04
445	300957	贝泰妮	2,200	149,974.00	0.04
446	00316	东方海外国际	1,500	148,166.97	0.04
447	000877	天山股份	22,000	146,960.00	0.04
448	600779	水井坊	2,500	146,925.00	0.04
449	688063	派能科技	1,357	143,842.00	0.03
450	688009	中国通号	32,375	141,802.50	0.03
451	601698	中国卫通	8,100	140,211.00	0.03
452	603613	国联股份	6,315	138,993.15	0.03
453	688561	奇安信	3,465	138,911.85	0.03
454	002120	韵达股份	18,600	138,756.00	0.03
455	06969	思摩尔国际	23,000	135,479.89	0.03
456	002080	中材科技	8,400	133,728.00	0.03
457	603893	瑞芯微	2,100	133,140.00	0.03
458	601155	新城控股	11,300	128,933.00	0.03
459	603737	三棵树	2,700	128,547.00	0.03
460	601231	环旭电子	8,400	126,924.00	0.03
461	688187	时代电气	3,416	124,103.28	0.03
462	600606	绿地控股	53,600	123,280.00	0.03
463	603185	弘元绿能	3,657	121,704.96	0.03
464	603486	科沃斯	2,900	120,176.00	0.03
465	688032	禾迈股份	441	119,070.00	0.03
466	00293	国泰航空	16,000	118,316.08	0.03
467	688082	盛美上海	1,112	116,103.92	0.03
468	000987	越秀资本	19,030	114,560.60	0.03
469	601808	中海油服	7,500	109,650.00	0.03
470	603568	伟明环保	6,600	105,600.00	0.03
471	300979	华利集团	1,900	100,016.00	0.02
472	003022	联泓新科	5,200	95,212.00	0.02
473	002945	华林证券	3,500	52,850.00	0.01
474	001289	龙源电力	2,000	39,620.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
2	688548	广钢气体	1,849	23,574.75	0.01

3	688563	航材股份	340	20,566.60	0.00
4	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
5	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
6	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
7	688591	泰凌微	666	18,661.32	0.00
8	301291	明阳电气	631	17,895.16	0.00
9	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
10	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
11	301498	乖宝宠物	380	14,747.80	0.00
12	603296	华勤技术	186	14,461.50	0.00
13	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
14	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
15	301468	博盈特焊	457	13,810.54	0.00
16	301511	德福科技	599	13,579.33	0.00
17	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
18	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
19	301371	敷尔佳	286	10,747.88	0.00
20	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
21	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
22	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
23	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
24	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
25	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
26	301559	中集环科	504	9,192.96	0.00
27	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
28	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
29	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
30	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
31	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
32	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
33	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
34	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
35	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
36	603062	麦加芯彩	107	6,185.67	0.00
37	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
38	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
39	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
40	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
41	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	02888	渣打集团	2,318,559.89	0.45
2	00700	腾讯控股	2,022,016.22	0.39
3	600519	贵州茅台	1,620,982.00	0.31
4	601816	京沪高铁	1,544,465.00	0.30
5	01211	比亚迪股份	810,182.51	0.16
5	002594	比亚迪	281,302.00	0.05
6	600941	中国移动	565,659.00	0.11
6	00941	中国移动	478,248.56	0.09
7	00005	汇丰控股	1,038,448.07	0.20
8	300308	中际旭创	952,463.00	0.18
9	688041	海光信息	942,706.13	0.18
10	300750	宁德时代	887,951.00	0.17
11	01299	友邦保险	792,793.58	0.15
12	688271	联影医疗	761,800.60	0.15
13	03690	美团-W	688,121.94	0.13
14	600028	中国石化	564,409.00	0.11
14	00386	中国石油化工 股份	91,172.38	0.02
15	00728	中国电信	577,805.04	0.11
15	601728	中国电信	67,275.00	0.01
16	601318	中国平安	347,415.00	0.07
16	02318	中国平安	280,866.10	0.05
17	600919	江苏银行	614,736.00	0.12
18	300760	迈瑞医疗	529,260.00	0.10
19	00939	建设银行	502,168.06	0.10
19	601939	建设银行	26,685.00	0.01
20	601916	浙商银行	526,995.80	0.10

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	601318	中国平安	4,898,931.00	0.95
1	02318	中国平安	796,664.51	0.15
2	00700	腾讯控股	5,642,418.73	1.09
3	00005	汇丰控股	3,507,802.65	0.68
4	03690	美团-W	3,225,875.07	0.62
5	01299	友邦保险	2,481,644.11	0.48
6	300750	宁德时代	1,816,861.00	0.35
7	00939	建设银行	1,362,229.41	0.26
7	601939	建设银行	24,778.00	0.00
8	00941	中国移动	1,264,259.20	0.24



8	600941	中国移动	28,051.00	0.01
9	002594	比亚迪	670,422.00	0.13
9	01211	比亚迪股份	502,835.69	0.10
10	000858	五粮液	966,729.00	0.19
11	00388	香港交易所	928,291.33	0.18
12	01398	工商银行	819,213.55	0.16
12	601398	工商银行	101,818.00	0.02
13	002415	海康威视	894,412.00	0.17
14	000333	美的集团	742,813.00	0.14
15	688428	诺诚健华	707,977.11	0.14
16	03968	招商银行	417,398.24	0.08
16	600036	招商银行	219,654.00	0.04
17	03988	中国银行	586,588.00	0.11
17	601988	中国银行	45,404.00	0.01
18	00981	中芯国际	570,713.49	0.11
18	688981	中芯国际	58,207.08	0.01
19	600900	长江电力	620,136.00	0.12
20	300059	东方财富	604,370.00	0.12

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	69,989,975.73
卖出股票收入（成交）总额	98,785,676.30

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,296.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	22,969.54
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	30,266.19

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.01	新股流通受限
2	688548	广钢气体	23,574.75	0.01	新股流通受限

3	688563	航材股份	20,566.60	0.00	新股流通受限
4	301421	波长光电	19,710.84	0.00	新股流通受限
5	688627	精智达	19,473.84	0.00	新股流通受限

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
14,736	41,924.06	30,402,112.00	4.92	587,390,888.00	95.08

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	8,371,464.00	1.36
2	霍尔果斯两比特科技有限公司	5,104,800.00	0.83
3	竞技世界(北京)网络技术有限公司	5,000,000.00	0.81
4	中信建投证券股份有限公司	3,662,348.00	0.59
5	但钧	3,000,000.00	0.49
6	周勇	3,000,000.00	0.49
7	郑碧珍	3,000,000.00	0.49
8	四川省宜宾晶鹏玻璃制品有限公司	3,000,000.00	0.49
9	那秀影	3,000,000.00	0.49
10	王东博	2,952,800.00	0.48

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	25,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	105,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	617,793,000.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2023 年 9 月 5 日，本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告，经本基金管理人董事会批准，邓列军先生自 2023 年 9 月 4 日起担任本基金管理人首席信息官职务。公司总经理王立新先生自 2023 年 9 月 4 日起不再代任首席信息官职务。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 90,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了三年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	6	77,250,219.77	47.87	45,525.77	45.37	新增2个交易单元
华创证券	2	27,433,715.53	17.00	20,156.81	20.09	-
中泰证券	2	23,552,946.95	14.59	17,221.71	17.16	-
广发证券	4	20,395,532.78	12.64	11,564.31	11.52	-
国投证券	4	9,312,798.31	5.77	3,365.96	3.35	-
中金公司	4	3,437,308.12	2.13	2,513.47	2.50	-
东方证券	2	7,344.00	0.00	2.55	0.00	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	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	3	-	-	-	-	新增1个交易单元
华金证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	新增

						2 个交易单元
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	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	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

川财证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证沪港深 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
6	《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
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 季度报告》	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 20 日
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
17	《银华基金管理股份有限公司关于增加华福证券有限责任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, 四大证券报	2023 年 7 月 7 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、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, 四大证券报	2023 年 7 月 17 日
19	《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 2 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 7 月 19 日
20	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 7 月 19 日
21	《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停牌股票估值调整情况的公告》	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 7 月 31 日
22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 8 月 29 日
23	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
24	《关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2023 年 9 月 1 日
25	《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 9 月 1 日
26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、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, 四大证券报	2023 年 9 月 1 日
27	《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(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 9 月 1 日

28	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、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, 四大证券报	2023 年 9 月 8 日
29	《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 9 月 21 日
30	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、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, 四大证券报	2023 年 10 月 9 日
31	《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 10 月 11 日
32	《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 10 月 19 日
33	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 10 月 24 日
34	《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 3 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 10 月 24 日
35	《银华基金管理股份有限公司关于增加浙商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, 四大证券报	2023 年 11 月 29 日
36	《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 12 月 21 日
37	《银华基金管理股份有限公司关于增加华金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, 四大证券报	2023 年 12 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 3 月 29 日