

银华中证 800 增强策略交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 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 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56

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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动.....	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	800 增强 ETF
场内简称	800 增强 ETF
基金主代码	159517
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 23 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	23,742,624.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强投资策略，主要包括（1）指数化投资策略：本基金指数化投资以标的指数的成份股组成及其权重为基础，确定本基金投资组合的基本构成和大致权重，并通过控制投资组合中个股权重对标的指数成份股权重的偏离，实现对标的指数的跟踪和对跟踪误差的控制。（2）量化增强投资策略：本基金将在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并在全市场优先选择综合评估价值较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整，以争取实现指数增强的目标。</p> <p>建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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 800 指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，采用指数增强投资策略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	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	《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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-27,479.76
本期利润	-364,720.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0129
本期加权平均净值利润率	-1.38%
本期基金份额净值增长率	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-1,334,482.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0562
期末基金资产净值	22,408,141.65
期末基金份额净值	0.9438
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.62%

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。

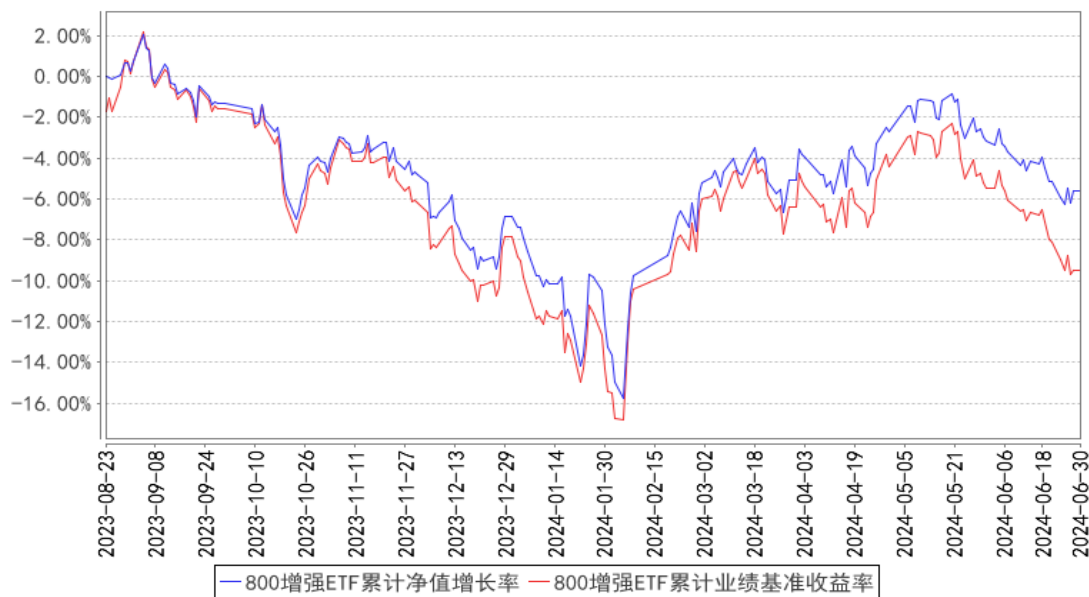
3.2 基金净值表现

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	-2.51%	0.54%	-4.23%	0.57%	1.72%	-0.03%
过去三个月	-0.58%	0.74%	-3.27%	0.83%	2.69%	-0.09%
过去六个月	1.33%	0.96%	-1.76%	1.03%	3.09%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-5.62%	0.84%	-9.48%	0.94%	3.86%	-0.10%

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

800增强ETF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08月23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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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。

§ 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 214 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
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、银华尊尚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、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、银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、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联接基金、银华新材料混合型发起式证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、银华晶鑫债券型证券投资基金、银华安泰债券型证券投资基金、银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 0-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银华盛泓债券型证券投资基金、银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金、银华钰祥债券型证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金、银华季季鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、银华富兴央企 6 个月封闭运作混合型发起式证券投资基金、银华月月鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金、银华嘉选平衡混合型发起式证券投资基金。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		
张凯先生	本基金的基金经理	2023年8月23日	-	14.5年	<p>硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加入银华基金, 历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理, 现任量化投资部副总监、基金经理。自2012年11月14日至2020年11月25日担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理, 自2013年11月5日至2019年9月26日兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理, 自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理, 自2016年4月7日起兼任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基金经理, 自2016年4月25日至2018年11月30日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 自2018年3月7日至2020年11月29日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理, 自2019年6月28日至2021年7月23日兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2019年8月29日至2020年12月31日兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理, 自2019年12月6日至2021年9月17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11月26日至2022年7月28日兼任银华中证等权重90指数证券投资基金(LOF)基金经理, 自2020年11月30日起兼任银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理, 自2021年1月1日起兼任银华深证100指数证券投资基金(LOF)基金经理, 自2021年2月3日至2022年2月23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5月13日至2022年6月17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2021年7月29日至2023年7月28日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2021年9月22日至2023年7月28日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自</p>

					2021 年 9 月 28 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、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 2021 年 11 月 19 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日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 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 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 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
王帅先生	本基金的基金经理	2023 年 8 月 23 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

				<p>金基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 20 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日至 2023 年 4 月 6 日兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 7 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 30 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日至 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</p>
--	--	--	--	--

					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, 自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍: 中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2023 年 8 月 23 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 800 增强策略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

2024 年上半年，宏观经济运行整体上呈现一季度上行、二季度小幅回落的节奏。对比一、二季度的经济表现，我们能够看到一些与往年不同的特征：节假日消费与经济活动恢复良好，而非节假日期间的淡季特征则较为明显。这些特征显示出一些新的信息：从周期角度，商务活动的复苏落后于整体水平；而从更长远视角来看，伴随一系列结构性的变化，中国经济的消费属性权重正在增加。海外方面，美联储降息周期比预期有所推迟，海外利率水平依旧在高位维持。在上述因素的作用下，A 股市场各主要宽基指数在上半年中涨跌互现。

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 0.9438 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.33%，业绩比较基准收益率为-1.76%。

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 2024 年下半年，我们仍然维持之前的观点。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，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，宏观政策、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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2023 年 12 月 19 日至 2024 年 1 月 30 日、2024 年 2 月 1 日至 2024 年 4 月 17 日、2024 年 4 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	978,332.83	835,360.20
结算备付金		111,668.50	254,525.69
存出保证金		20,888.57	69,939.49
交易性金融资产	6.4.7.2	21,401,917.15	35,042,185.11
其中：股票投资		21,401,917.15	35,042,185.11
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	-	-
资产总计		22,512,807.05	36,202,010.49
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.12	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		9,305.53	15,479.29
应付托管费		1,861.10	3,095.88
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	93,497.65	99,680.41
负债合计		104,665.40	118,255.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	23,742,624.00	38,742,624.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,334,482.35	-2,658,869.09
净资产合计		22,408,141.65	36,083,754.91
负债和净资产总计		22,512,807.05	36,202,010.49

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9438 元，基金份额总额 23,742,624.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-232,809.73
1. 利息收入		4,970.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,970.63
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）		98,528.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-195,192.49
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	293,721.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-

其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-337,240.34
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	931.07
减：二、营业总支出		131,910.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	65,206.66
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,041.38
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	53,662.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-364,720.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-364,720.10
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-364,720.10

注：本基金合同生效日为 2023 年 08 月 23 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	38,742,624.00	-	-2,658,869.09	36,083,754.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,742,624.00	-	-2,658,869.09	36,083,754.91
三、本期增减变	-15,000,000.00	-	1,324,386.74	-13,675,613.26

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-364,720.10	-364,720.10
(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)	-15,000,000.00	-	1,689,106.84	-13,310,893.16
其中：1. 基金申购款	72,000,000.00	-	-5,395,942.53	66,604,057.47
2. 基金赎回款	-87,000,000.00	-	7,085,049.37	-79,914,950.63
(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	23,742,624.00	-	-1,334,482.35	22,408,141.65

注：本基金合同生效日为 2023 年 08 月 23 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 800 增强策略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[2023]1419 号《关于准予银华中证 800 增强策略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 800 增强策略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 245,731,000.00 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(2023)第 0421 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2023 年 8 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 245,742,624.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 11,624.00 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深圳上[2023]810 号核准,本基金 245,742,624.00 份基金份额于 2023 年 9 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 800 增强策略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(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。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	978,332.83
等于：本金	978,237.76
加：应计利息	95.07
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	978,332.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	22,047,046.51	-	21,401,917.15	-645,129.36
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		22,047,046.51	-	21,401,917.15	-645,129.36

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	34,819.74
其中：交易所市场	34,819.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,677.91
合计	93,497.65

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,742,624.00	38,742,624.00
本期申购	72,000,000.00	72,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-87,000,000.00	-87,000,000.00
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	23,742,624.00	23,742,624.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,027,241.06	-631,628.03	-2,658,869.09

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,027,241.06	-631,628.03	-2,658,869.09
本期利润	-27,479.76	-337,240.34	-364,720.10
本期基金份额交易产生的变动数	1,137,801.07	551,305.77	1,689,106.84
其中：基金申购款	-4,554,427.49	-841,515.04	-5,395,942.53
基金赎回款	5,692,228.56	1,392,820.81	7,085,049.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-916,919.75	-417,562.60	-1,334,482.35

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	2,613.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,002.09
其他	355.00
合计	4,970.63

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	489,269.79
股票投资收益——赎回差价收入	-684,462.28
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-195,192.49

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	115,134,146.90
减：卖出股票成本总额	114,496,415.11
减：交易费用	148,462.00
买卖股票差价收入	489,269.79

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	79,914,950.63
减：现金支付赎回款总额	56,116,133.63
减：赎回股票成本总额	24,483,279.28
减：交易费用	-
赎回差价收入	-684,462.28

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	293,721.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	293,721.40

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-337,240.34
股票投资	-337,240.34
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	-337,240.34

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	931.07
合计	931.07

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	1,447.95
其他	9,946.70
合计	53,662.33

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司（“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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	65,206.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,709.10
应支付基金管理人的净管理费	62,497.56

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最

近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,041.38

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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自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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	978,332.83	2,613.54

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（2024 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

注：无。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	978,332.83	-	-	-	978,332.83
结算备付金	111,668.50	-	-	-	111,668.50
存出保证金	20,888.57	-	-	-	20,888.57
交易性金融资产	-	-	-	21,401,917.15	21,401,917.15
资产总计	1,110,889.90	-	-	21,401,917.15	22,512,807.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,305.53	9,305.53
应付托管费	-	-	-	1,861.10	1,861.10
应付清算款	-	-	-	1.12	1.12
其他负债	-	-	-	93,497.65	93,497.65
负债总计	-	-	-	104,665.40	104,665.40
利率敏感度缺口	1,110,889.90	-	-	21,297,251.75	22,408,141.65
上年度末 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	835,360.20	-	-	-	835,360.20
结算备付金	254,525.69	-	-	-	254,525.69
存出保证金	69,939.49	-	-	-	69,939.49
交易性金融资产	-	-	-	35,042,185.11	35,042,185.11
资产总计	1,159,825.38	-	-	35,042,185.11	36,202,010.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,479.29	15,479.29
应付托管费	-	-	-	3,095.88	3,095.88
其他负债	-	-	-	99,680.41	99,680.41
负债总计	-	-	-	118,255.58	118,255.58
利率敏感度缺口	1,159,825.38	-	-	34,923,929.53	36,083,754.91

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

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	21,401,917.15	95.51	35,042,185.11	97.11
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	21,401,917.15	95.51	35,042,185.11	97.11

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%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	968,395.96	1,392,179.15
	业绩比较基准下降 5%	-968,395.96	-1,392,179.15

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	21,401,917.15	35,026,921.11
第二层次	-	15,264.00
第三层次	-	-

合计	21,401,917.15	35,042,185.11
----	---------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,401,917.15	95.07
	其中：股票	21,401,917.15	95.07
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	1,090,001.33	4.84
8	其他各项资产	20,888.57	0.09
9	合计	22,512,807.05	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	263,785.00	1.18
B	采矿业	1,223,821.00	5.46
C	制造业	11,006,782.08	49.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,146,239.00	5.12
E	建筑业	667,527.00	2.98
F	批发和零售业	53,962.80	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	797,956.00	3.56
H	住宿和餐饮业	2,298.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,118,150.78	4.99
J	金融业	3,408,704.00	15.21
K	房地产业	190,958.00	0.85
L	租赁和商务服务业	161,717.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	90,688.67	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	2,511.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,828.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	162,321.00	0.72
S	综合	4,224.00	0.02
	合计	20,326,473.33	90.71

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,740.00	0.03
B	采矿业	9,674.00	0.04
C	制造业	582,422.54	2.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,882.00	0.12
E	建筑业	28,705.00	0.13
F	批发和零售业	63,700.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	34,535.00	0.15

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,165.28	0.55
J	金融业	91,702.00	0.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	62,078.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	8,228.00	0.04
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	3,533.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	34,079.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	1,075,443.82	4.80

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	600519	贵州茅台	600	880,434.00	3.93
2	300750	宁德时代	2,300	414,069.00	1.85
3	000725	京东方A	87,300	357,057.00	1.59
4	601318	中国平安	8,000	330,880.00	1.48
5	600028	中国石化	47,800	302,096.00	1.35
6	601166	兴业银行	15,000	264,300.00	1.18
7	002475	立讯精密	6,200	243,722.00	1.09
8	000338	潍柴动力	14,000	227,360.00	1.01
9	600406	国电南瑞	9,100	227,136.00	1.01
10	601728	中国电信	35,700	219,555.00	0.98
11	601398	工商银行	37,200	212,040.00	0.95
12	601668	中国建筑	39,500	209,745.00	0.94
13	600219	南山铝业	48,800	185,928.00	0.83
14	601939	建设银行	25,000	185,000.00	0.83
15	601899	紫金矿业	10,100	177,457.00	0.79
16	600919	江苏银行	23,200	172,376.00	0.77

17	000651	格力电器	4,300	168,646.00	0.75
18	600426	华鲁恒升	6,300	167,832.00	0.75
19	601601	中国太保	5,800	161,588.00	0.72
20	600000	浦发银行	18,300	150,609.00	0.67
21	600795	国电电力	25,100	150,349.00	0.67
22	601658	邮储银行	27,900	141,453.00	0.63
23	601600	中国铝业	18,500	141,155.00	0.63
24	000858	五粮液	1,100	140,844.00	0.63
25	002252	上海莱士	18,000	140,760.00	0.63
26	002384	东山精密	6,700	138,690.00	0.62
27	600690	海尔智家	4,800	136,224.00	0.61
28	000333	美的集团	2,100	135,450.00	0.60
29	002273	水晶光电	7,700	130,746.00	0.58
30	603228	景旺电子	4,100	130,380.00	0.58
31	600989	宝丰能源	7,500	129,975.00	0.58
32	601328	交通银行	17,300	129,231.00	0.58
33	002128	电投能源	6,000	126,600.00	0.56
34	002027	分众传媒	20,500	124,230.00	0.55
35	688111	金山办公	528	120,120.00	0.54
36	601919	中远海控	7,700	119,273.00	0.53
37	601816	京沪高铁	22,000	118,140.00	0.53
38	600585	海螺水泥	5,000	117,950.00	0.53
39	300760	迈瑞医疗	400	116,364.00	0.52
40	601169	北京银行	19,900	116,216.00	0.52
41	601229	上海银行	15,900	115,434.00	0.52
42	600660	福耀玻璃	2,400	114,960.00	0.51
43	600875	东方电气	6,200	114,390.00	0.51
44	600900	长江电力	3,900	112,788.00	0.50
45	002142	宁波银行	5,100	112,506.00	0.50
46	600019	宝钢股份	16,800	111,720.00	0.50
47	600161	天坛生物	4,440	108,336.00	0.48
48	601231	环旭电子	6,700	107,535.00	0.48
49	600547	山东黄金	3,900	106,782.00	0.48
50	600029	南方航空	17,900	105,431.00	0.47
51	300498	温氏股份	5,300	105,046.00	0.47
52	000408	藏格矿业	4,200	101,094.00	0.45
53	601298	青岛港	10,500	100,380.00	0.45
54	300433	蓝思科技	5,500	100,375.00	0.45
55	600276	恒瑞医药	2,600	99,996.00	0.45
56	600018	上港集团	17,300	99,994.00	0.45
57	600039	四川路桥	12,500	98,625.00	0.44
58	601390	中国中铁	14,900	97,148.00	0.43
59	002415	海康威视	3,100	95,821.00	0.43

60	600887	伊利股份	3,700	95,608.00	0.43
61	000001	平安银行	9,300	94,395.00	0.42
62	601717	郑煤机	6,300	93,240.00	0.42
63	600674	川投能源	4,900	91,875.00	0.41
64	600588	用友网络	9,100	91,000.00	0.41
65	600016	民生银行	24,000	90,960.00	0.41
66	300408	三环集团	3,100	90,489.00	0.40
67	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.40
68	000100	TCL 科技	20,600	88,992.00	0.40
69	601077	渝农商行	17,700	88,854.00	0.40
70	002304	洋河股份	1,100	88,814.00	0.40
71	000830	鲁西化工	7,400	85,766.00	0.38
72	601117	中国化学	10,300	84,872.00	0.38
73	002241	歌尔股份	4,300	83,893.00	0.37
74	600642	申能股份	9,400	83,002.00	0.37
75	601881	中国银河	7,600	82,536.00	0.37
76	601865	福莱特	4,100	82,410.00	0.37
77	600845	宝信软件	2,500	79,825.00	0.36
78	601288	农业银行	18,100	78,916.00	0.35
79	002185	华天科技	9,600	78,240.00	0.35
80	601138	工业富联	2,800	76,720.00	0.34
81	601928	凤凰传媒	6,900	75,624.00	0.34
82	600741	华域汽车	4,600	75,348.00	0.34
83	600150	中国船舶	1,800	73,278.00	0.33
84	600967	内蒙一机	10,000	72,000.00	0.32
85	600901	江苏金租	14,100	71,205.00	0.32
86	300999	金龙鱼	2,600	71,110.00	0.32
87	600377	宁沪高速	5,600	70,560.00	0.31
88	600380	健康元	6,300	70,371.00	0.31
89	000738	航发控制	3,500	70,245.00	0.31
90	600025	华能水电	6,500	70,070.00	0.31
91	000883	湖北能源	11,400	68,514.00	0.31
92	600663	陆家嘴	7,700	67,914.00	0.30
93	000598	兴蓉环境	9,000	67,680.00	0.30
94	600598	北大荒	5,400	67,446.00	0.30
95	601808	中海油服	3,900	67,080.00	0.30
96	600999	招商证券	4,800	66,768.00	0.30
97	600050	中国联通	14,200	66,740.00	0.30
98	300124	汇川技术	1,300	66,690.00	0.30
99	000999	华润三九	1,560	66,424.80	0.30
100	002408	齐翔腾达	11,800	66,080.00	0.29
101	002532	天山铝业	8,100	65,691.00	0.29
102	300529	健帆生物	2,400	65,304.00	0.29

103	300142	沃森生物	5,700	64,866.00	0.29
104	600521	华海药业	3,800	64,790.00	0.29
105	688036	传音控股	843	64,523.22	0.29
106	002371	北方华创	200	63,978.00	0.29
107	002938	鹏鼎控股	1,600	63,616.00	0.28
108	600809	山西汾酒	300	63,264.00	0.28
109	601225	陕西煤业	2,400	61,848.00	0.28
110	002019	亿帆医药	5,000	61,800.00	0.28
111	600011	华能国际	6,400	61,568.00	0.27
112	600008	首创环保	22,400	60,032.00	0.27
113	000166	申万宏源	13,900	59,909.00	0.27
114	601216	君正集团	16,200	59,778.00	0.27
115	601211	国泰君安	4,400	59,620.00	0.27
116	600346	恒力石化	4,200	58,590.00	0.26
117	601098	中南传媒	4,700	58,374.00	0.26
118	601857	中国石油	5,600	57,792.00	0.26
119	000568	泸州老窖	400	57,396.00	0.26
120	601618	中国中冶	18,500	57,350.00	0.26
121	000683	远兴能源	8,200	56,662.00	0.25
122	601633	长城汽车	2,200	55,660.00	0.25
123	688303	大全能源	2,705	55,154.95	0.25
124	600015	华夏银行	8,600	55,040.00	0.25
125	603259	药明康德	1,400	54,866.00	0.24
126	601088	中国神华	1,200	53,244.00	0.24
127	601766	中国中车	7,000	52,570.00	0.23
128	600309	万华化学	650	52,559.00	0.23
129	600732	爱旭股份	5,800	52,490.00	0.23
130	300308	中际旭创	380	52,394.40	0.23
131	601985	中国核电	4,900	52,234.00	0.23
132	600048	保利发展	5,900	51,684.00	0.23
133	601818	光大银行	16,200	51,354.00	0.23
134	601788	光大证券	3,500	51,170.00	0.23
135	603369	今世缘	1,100	50,820.00	0.23
136	603225	新凤鸣	3,200	49,888.00	0.22
137	600905	三峡能源	11,400	49,704.00	0.22
138	002299	圣农发展	3,600	49,104.00	0.22
139	300059	东方财富	4,600	48,576.00	0.22
140	601186	中国铁建	5,600	47,992.00	0.21
141	300014	亿纬锂能	1,200	47,904.00	0.21
142	001289	龙源电力	2,700	46,575.00	0.21
143	001979	招商蛇口	5,200	45,708.00	0.20
144	603317	天味食品	4,000	45,640.00	0.20
145	601336	新华保险	1,500	45,045.00	0.20

146	600956	新天绿能	5,500	44,935.00	0.20
147	002180	纳思达	1,700	44,914.00	0.20
148	601916	浙商银行	16,200	44,712.00	0.20
149	002841	视源股份	1,500	44,295.00	0.20
150	002050	三花智控	2,300	43,884.00	0.20
151	600600	青岛啤酒	600	43,662.00	0.19
152	688981	中芯国际	928	42,780.80	0.19
153	600183	生益科技	2,000	42,120.00	0.19
154	002353	杰瑞股份	1,200	42,096.00	0.19
155	601877	正泰电器	2,200	41,932.00	0.19
156	600535	天士力	3,300	41,514.00	0.19
157	601898	中煤能源	3,300	41,184.00	0.18
158	603993	洛阳钼业	4,700	39,950.00	0.18
159	002714	牧原股份	900	39,240.00	0.18
160	688778	厦钨新能	1,253	39,143.72	0.17
161	603986	兆易创新	400	38,248.00	0.17
162	002179	中航光电	1,000	38,050.00	0.17
163	000887	中鼎股份	3,100	37,944.00	0.17
164	688120	华海清科	200	37,916.00	0.17
165	601100	恒立液压	800	37,264.00	0.17
166	601111	中国国航	5,000	36,900.00	0.16
167	000728	国元证券	6,000	36,360.00	0.16
168	600438	通威股份	1,900	36,309.00	0.16
169	600938	中国海油	1,100	36,300.00	0.16
170	600115	中国东航	9,000	36,090.00	0.16
171	601615	明阳智能	3,800	35,872.00	0.16
172	688248	南网科技	1,209	35,822.67	0.16
173	600489	中金黄金	2,400	35,520.00	0.16
174	600803	新奥股份	1,700	35,360.00	0.16
175	688008	澜起科技	613	35,039.08	0.16
176	600031	三一重工	2,100	34,650.00	0.15
177	002152	广电运通	3,300	34,518.00	0.15
178	300316	晶盛机电	1,200	34,476.00	0.15
179	601577	长沙银行	4,200	34,356.00	0.15
180	600760	中航沈飞	820	32,882.00	0.15
181	600886	国投电力	1,800	32,832.00	0.15
182	300803	指南针	900	32,769.00	0.15
183	000156	华数传媒	5,200	32,656.00	0.15
184	600372	中航机载	2,700	32,319.00	0.14
185	600941	中国移动	300	32,250.00	0.14
186	601689	拓普集团	600	32,166.00	0.14
187	688772	珠海冠宇	2,132	31,766.80	0.14
188	603589	口子窖	800	31,352.00	0.14

189	001286	陕西能源	2,700	31,131.00	0.14
190	601628	中国人寿	1,000	31,050.00	0.14
191	000625	长安汽车	2,300	30,889.00	0.14
192	688041	海光信息	439	30,870.48	0.14
193	000425	徐工机械	4,300	30,745.00	0.14
194	600085	同仁堂	800	30,568.00	0.14
195	601998	中信银行	4,400	29,480.00	0.13
196	600958	东方证券	3,800	28,880.00	0.13
197	300146	汤臣倍健	2,100	28,455.00	0.13
198	600549	厦门钨业	1,600	27,600.00	0.12
199	603288	海天味业	800	27,576.00	0.12
200	601139	深圳燃气	4,100	27,388.00	0.12
201	601872	招商轮船	3,200	27,040.00	0.12
202	601698	中国卫通	1,900	26,771.00	0.12
203	603806	福斯特	1,820	26,754.00	0.12
204	000768	中航西飞	1,100	26,433.00	0.12
205	002821	凯莱英	400	26,320.00	0.12
206	300037	新宙邦	900	25,704.00	0.11
207	688029	南微医学	416	25,608.96	0.11
208	000538	云南白药	500	25,575.00	0.11
209	000977	浪潮信息	700	25,459.00	0.11
210	601012	隆基绿能	1,800	25,236.00	0.11
211	002648	卫星化学	1,400	25,172.00	0.11
212	000800	一汽解放	3,200	25,056.00	0.11
213	002594	比亚迪	100	25,025.00	0.11
214	601990	南京证券	3,200	24,576.00	0.11
215	300383	光环新网	2,900	24,505.00	0.11
216	603606	东方电缆	500	24,405.00	0.11
217	601636	旗滨集团	3,700	23,865.00	0.11
218	688099	晶晨股份	400	23,728.00	0.11
219	002001	新和成	1,200	23,040.00	0.10
220	300628	亿联网络	600	22,062.00	0.10
221	601991	大唐发电	7,300	21,973.00	0.10
222	600970	中材国际	1,800	21,708.00	0.10
223	002352	顺丰控股	600	21,414.00	0.10
224	000596	古井贡酒	101	21,318.07	0.10
225	300502	新易盛	200	21,110.00	0.09
226	002466	天齐锂业	700	20,937.00	0.09
227	002507	涪陵榨菜	1,700	20,825.00	0.09
228	300033	同花顺	200	20,740.00	0.09
229	603927	中科软	1,140	20,622.60	0.09
230	002487	大金重工	900	20,592.00	0.09
231	689009	九号公司	559	20,576.79	0.09

232	600332	白云山	700	20,531.00	0.09
233	002568	百润股份	1,200	20,196.00	0.09
234	002074	国轩高科	1,000	19,150.00	0.09
235	600348	华阳股份	1,900	18,924.00	0.08
236	002236	大华股份	1,200	18,552.00	0.08
237	600023	浙能电力	2,600	18,486.00	0.08
238	002653	海思科	600	18,420.00	0.08
239	000933	神火股份	900	18,207.00	0.08
240	605117	德业股份	240	17,841.60	0.08
241	002472	双环传动	800	17,616.00	0.08
242	000792	盐湖股份	1,000	17,450.00	0.08
243	002444	巨星科技	700	17,290.00	0.08
244	600879	航天电子	2,200	17,094.00	0.08
245	600704	物产中大	3,900	16,926.00	0.08
246	601021	春秋航空	300	16,899.00	0.08
247	300122	智飞生物	600	16,818.00	0.08
248	000063	中兴通讯	600	16,782.00	0.07
249	603707	健友股份	1,400	16,632.00	0.07
250	601009	南京银行	1,600	16,624.00	0.07
251	002340	格林美	2,600	16,562.00	0.07
252	300015	爱尔眼科	1,600	16,512.00	0.07
253	002120	韵达股份	2,100	16,254.00	0.07
254	300677	英科医疗	600	16,086.00	0.07
255	002558	巨人网络	1,700	16,048.00	0.07
256	000932	华菱钢铁	3,600	15,948.00	0.07
257	601006	大秦铁路	2,200	15,752.00	0.07
258	600177	雅戈尔	2,200	15,664.00	0.07
259	601669	中国电建	2,800	15,652.00	0.07
260	002465	海格通信	1,500	15,540.00	0.07
261	600096	云天化	800	15,536.00	0.07
262	600497	驰宏锌锗	2,900	15,486.00	0.07
263	600066	宇通客车	600	15,480.00	0.07
264	002850	科达利	200	15,276.00	0.07
265	300144	宋城演艺	1,900	15,257.00	0.07
266	002497	雅化集团	1,700	15,164.00	0.07
267	002423	中粮资本	2,000	14,980.00	0.07
268	600536	中国软件	500	14,960.00	0.07
269	603195	公牛集团	190	14,652.80	0.07
270	600893	航发动力	400	14,620.00	0.07
271	000157	中联重科	1,900	14,592.00	0.07
272	600582	天地科技	2,100	14,469.00	0.06
273	002064	华峰化学	2,000	14,340.00	0.06
274	002531	天顺风能	1,600	14,304.00	0.06

275	688375	国博电子	200	14,128.00	0.06
276	002311	海大集团	300	14,115.00	0.06
277	600839	四川长虹	3,100	13,919.00	0.06
278	002025	航天电器	300	13,914.00	0.06
279	000963	华东医药	500	13,905.00	0.06
280	688520	神州细胞	351	13,811.85	0.06
281	603185	弘元绿能	800	13,672.00	0.06
282	603529	爱玛科技	500	13,665.00	0.06
283	600968	海油发展	3,300	13,596.00	0.06
284	002493	荣盛石化	1,400	13,524.00	0.06
285	600141	兴发集团	700	13,356.00	0.06
286	688561	奇安信	564	13,321.68	0.06
287	603799	华友钴业	600	13,278.00	0.06
288	600820	隧道股份	2,000	13,060.00	0.06
289	600566	济川药业	400	12,684.00	0.06
290	688223	晶科能源	1,769	12,559.90	0.06
291	000778	新兴铸管	3,600	12,528.00	0.06
292	002008	大族激光	600	12,480.00	0.06
293	002056	横店东磁	1,000	12,470.00	0.06
294	002410	广联达	1,300	12,454.00	0.06
295	600528	中铁工业	1,700	12,444.00	0.06
296	000563	陕国投 A	4,500	12,375.00	0.06
297	600707	彩虹股份	1,800	12,258.00	0.05
298	601868	中国能建	5,700	12,084.00	0.05
299	000703	恒逸石化	1,700	12,053.00	0.05
300	600095	湘财股份	2,000	11,920.00	0.05
301	600061	国投资本	2,100	11,865.00	0.05
302	000559	万向钱潮	2,600	11,596.00	0.05
303	688126	沪硅产业	810	11,186.10	0.05
304	600298	安琪酵母	400	11,172.00	0.05
305	601238	广汽集团	1,400	10,836.00	0.05
306	002372	伟星新材	700	10,794.00	0.05
307	300207	欣旺达	700	10,619.00	0.05
308	002916	深南电路	100	10,577.00	0.05
309	600737	中粮糖业	1,100	10,549.00	0.05
310	002563	森马服饰	1,800	10,458.00	0.05
311	000002	万 科 A	1,500	10,395.00	0.05
312	600111	北方稀土	600	10,320.00	0.05
313	002831	裕同科技	400	10,236.00	0.05
314	300454	深信服	200	10,106.00	0.05
315	600985	淮北矿业	600	10,044.00	0.04
316	600755	厦门国贸	1,400	10,038.00	0.04
317	601568	北元集团	2,700	10,017.00	0.04

318	300699	光威复材	400	9,932.00	0.04
319	600126	杭钢股份	2,400	9,864.00	0.04
320	600764	中国海防	500	9,815.00	0.04
321	000709	河钢股份	5,000	9,700.00	0.04
322	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.04
323	600885	宏发股份	344	9,521.92	0.04
324	688114	华大智造	200	9,482.00	0.04
325	002007	华兰生物	600	9,474.00	0.04
326	300253	卫宁健康	1,600	9,440.00	0.04
327	002601	龙佰集团	500	9,285.00	0.04
328	600399	抚顺特钢	1,600	9,008.00	0.04
329	300003	乐普医疗	600	8,904.00	0.04
330	000786	北新建材	300	8,898.00	0.04
331	300394	天孚通信	100	8,842.00	0.04
332	600570	恒生电子	500	8,830.00	0.04
333	300274	阳光电源	140	8,684.20	0.04
334	300390	天华新能	500	8,590.00	0.04
335	600282	南钢股份	1,700	8,466.00	0.04
336	002044	美年健康	2,200	8,316.00	0.04
337	000983	山西焦煤	800	8,248.00	0.04
338	600988	赤峰黄金	500	8,170.00	0.04
339	600415	小商品城	1,100	8,162.00	0.04
340	002683	广东宏大	400	8,052.00	0.04
341	601155	新城控股	900	7,983.00	0.04
342	300136	信维通信	400	7,832.00	0.03
343	300373	扬杰科技	200	7,780.00	0.03
344	301269	华大九天	100	7,705.00	0.03
345	688122	西部超导	200	7,664.00	0.03
346	688396	华润微	200	7,488.00	0.03
347	002281	光迅科技	200	7,474.00	0.03
348	600060	海信视像	300	7,422.00	0.03
349	600373	中文传媒	500	7,420.00	0.03
350	600699	均胜电子	500	7,410.00	0.03
351	601699	潞安环能	400	7,252.00	0.03
352	688599	天合光能	423	7,157.16	0.03
353	300866	安克创新	100	7,121.00	0.03
354	301236	软通动力	200	7,042.00	0.03
355	002709	天赐材料	400	7,024.00	0.03
356	605358	立昂微	300	6,942.00	0.03
357	002439	启明星辰	400	6,904.00	0.03
358	600801	华新水泥	500	6,875.00	0.03
359	600339	中油工程	2,200	6,864.00	0.03
360	002065	东华软件	1,500	6,780.00	0.03

361	300296	利亚德	1,500	6,750.00	0.03
362	603786	科博达	100	6,415.00	0.03
363	002373	千方科技	700	6,349.00	0.03
364	603899	晨光股份	200	6,256.00	0.03
365	601888	中国中免	100	6,249.00	0.03
366	601958	金铂股份	600	6,246.00	0.03
367	000630	铜陵有色	1,700	6,137.00	0.03
368	000066	中国长城	700	6,125.00	0.03
369	300979	华利集团	100	6,085.00	0.03
370	600132	重庆啤酒	100	6,070.00	0.03
371	600516	方大炭素	1,400	6,034.00	0.03
372	600299	安迪苏	600	5,820.00	0.03
373	002517	恺英网络	600	5,730.00	0.03
374	600486	扬农化工	100	5,645.00	0.03
375	002557	洽洽食品	200	5,638.00	0.03
376	000039	中集集团	600	5,556.00	0.02
377	300017	网宿科技	700	5,530.00	0.02
378	603712	七一二	300	5,457.00	0.02
379	601933	永辉超市	2,200	5,456.00	0.02
380	002738	中矿资源	200	5,360.00	0.02
381	002518	科士达	300	5,310.00	0.02
382	688425	铁建重工	1,425	5,244.00	0.02
383	300088	长信科技	1,100	5,170.00	0.02
384	601319	中国人保	1,000	5,150.00	0.02
385	000027	深圳能源	700	5,110.00	0.02
386	300450	先导智能	300	4,989.00	0.02
387	000878	云南铜业	400	4,984.00	0.02
388	000898	鞍钢股份	2,300	4,876.00	0.02
389	000785	居然之家	2,000	4,860.00	0.02
390	002429	兆驰股份	1,000	4,810.00	0.02
391	603260	合盛硅业	100	4,671.00	0.02
392	000960	锡业股份	300	4,647.00	0.02
393	600143	金发科技	700	4,627.00	0.02
394	603658	安图生物	100	4,607.00	0.02
395	300776	帝尔激光	100	4,596.00	0.02
396	600188	兖矿能源	200	4,546.00	0.02
397	601598	中国外运	800	4,504.00	0.02
398	300058	蓝色光标	800	4,352.00	0.02
399	000009	中国宝安	500	4,300.00	0.02
400	600673	东阳光	600	4,224.00	0.02
401	603883	老百姓	230	4,222.80	0.02
402	601058	赛轮轮胎	300	4,200.00	0.02
403	003816	中国广核	900	4,167.00	0.02

404	000959	首钢股份	1,500	4,080.00	0.02
405	603826	坤彩科技	140	4,055.80	0.02
406	600959	江苏有线	1,500	3,960.00	0.02
407	600062	华润双鹤	200	3,916.00	0.02
408	603379	三美股份	100	3,914.00	0.02
409	001872	招商港口	200	3,850.00	0.02
410	002595	豪迈科技	100	3,817.00	0.02
411	002223	鱼跃医疗	100	3,760.00	0.02
412	600862	中航高科	200	3,756.00	0.02
413	000513	丽珠集团	100	3,721.00	0.02
414	600398	海澜之家	400	3,696.00	0.02
415	600271	航天信息	500	3,680.00	0.02
416	601966	玲珑轮胎	200	3,674.00	0.02
417	600848	上海临港	400	3,644.00	0.02
418	002244	滨江集团	500	3,630.00	0.02
419	600859	王府井	300	3,522.00	0.02
420	002153	石基信息	600	3,438.00	0.02
421	600352	浙江龙盛	400	3,436.00	0.02
422	002202	金风科技	500	3,360.00	0.01
423	688006	杭可科技	190	3,315.50	0.01
424	002690	美亚光电	200	3,300.00	0.01
425	688107	安路科技	129	3,279.18	0.01
426	600977	中国电影	300	3,228.00	0.01
427	300418	昆仑万维	100	3,224.00	0.01
428	600498	烽火通信	200	3,180.00	0.01
429	300595	欧普康视	200	3,136.00	0.01
430	601016	节能风电	1,000	2,990.00	0.01
431	600416	湘电股份	300	2,982.00	0.01
432	600021	上海电力	300	2,967.00	0.01
433	000967	盈峰环境	700	2,961.00	0.01
434	000998	隆平高科	300	2,949.00	0.01
435	603939	益丰药房	120	2,946.00	0.01
436	600129	太极集团	100	2,892.00	0.01
436	601456	国联证券	300	2,892.00	0.01
437	603233	大参林	200	2,860.00	0.01
438	601000	唐山港	600	2,820.00	0.01
439	002078	太阳纸业	200	2,790.00	0.01
440	002138	顺络电子	100	2,746.00	0.01
441	000876	新希望	300	2,742.00	0.01
442	601696	中银证券	300	2,724.00	0.01
443	000708	中信特钢	200	2,714.00	0.01
444	000623	吉林敖东	200	2,680.00	0.01
444	002958	青农商行	1,000	2,680.00	0.01

445	601608	中信重工	700	2,667.00	0.01
446	002294	信立泰	100	2,663.00	0.01
447	600350	山东高速	300	2,655.00	0.01
448	000636	风华高科	200	2,612.00	0.01
449	002791	坚朗五金	100	2,587.00	0.01
450	600435	北方导航	300	2,586.00	0.01
451	600529	山东药玻	100	2,534.00	0.01
452	002266	浙富控股	900	2,511.00	0.01
453	300002	神州泰岳	300	2,436.00	0.01
454	600637	东方明珠	400	2,432.00	0.01
455	601611	中国核建	300	2,427.00	0.01
456	002739	万达电影	200	2,418.00	0.01
457	601179	中国西电	300	2,412.00	0.01
458	002203	海亮股份	300	2,394.00	0.01
459	000591	太阳能	500	2,355.00	0.01
460	002506	协鑫集成	1,200	2,328.00	0.01
461	600754	锦江酒店	100	2,298.00	0.01
462	600166	福田汽车	1,000	2,250.00	0.01
463	002459	晶澳科技	200	2,240.00	0.01
463	601666	平煤股份	200	2,240.00	0.01
464	002430	杭氧股份	100	2,225.00	0.01
465	600827	百联股份	300	2,214.00	0.01
466	600176	中国巨石	200	2,210.00	0.01
467	000155	川能动力	200	2,154.00	0.01
468	603156	养元饮品	100	2,127.00	0.01
469	603305	旭升集团	200	2,112.00	0.01
470	601828	美凯龙	800	2,040.00	0.01
471	601607	上海医药	100	1,911.00	0.01
472	600153	建发股份	200	1,786.00	0.01
473	002195	岩山科技	700	1,757.00	0.01
474	600392	盛和资源	200	1,724.00	0.01
475	600499	科达制造	200	1,686.00	0.01
476	300568	星源材质	200	1,640.00	0.01
477	600390	五矿资本	400	1,620.00	0.01
478	002385	大北农	400	1,540.00	0.01
479	002572	索菲亚	100	1,533.00	0.01
480	601988	中国银行	300	1,386.00	0.01
481	603456	九洲药业	100	1,372.00	0.01
482	601236	红塔证券	200	1,284.00	0.01
483	688213	思特威	23	1,115.50	0.00
484	000723	美锦能源	200	952.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601528	瑞丰银行	19,000	89,680.00	0.40
2	000415	渤海租赁	18,100	46,155.00	0.21
3	600976	健民集团	900	45,450.00	0.20
4	688088	虹软科技	1,496	43,174.56	0.19
5	605111	新洁能	1,160	35,484.40	0.16
6	600559	老白干酒	1,900	34,542.00	0.15
7	300633	开立医疗	700	27,706.00	0.12
8	600223	福瑞达	3,700	26,159.00	0.12
9	002123	梦网科技	3,700	26,011.00	0.12
10	301155	海力风电	600	24,138.00	0.11
11	601921	浙版传媒	3,100	23,684.00	0.11
12	688596	正帆科技	715	23,595.00	0.11
13	605589	圣泉集团	1,000	20,290.00	0.09
14	300679	电连技术	500	20,115.00	0.09
15	002249	大洋电机	3,700	17,501.00	0.08
16	603279	景津装备	800	17,352.00	0.08
17	002034	旺能环境	1,200	15,612.00	0.07
18	301087	可孚医疗	400	13,560.00	0.06
19	601311	骆驼股份	1,600	12,832.00	0.06
20	600662	外服控股	3,100	12,431.00	0.06
21	603997	继峰股份	1,200	12,276.00	0.05
22	603128	华贸物流	2,100	12,117.00	0.05
23	600491	龙元建设	4,300	11,782.00	0.05
24	601975	招商南油	3,200	11,488.00	0.05
25	002456	欧菲光	1,400	10,934.00	0.05
26	688266	泽璟制药	200	10,844.00	0.05
27	000650	仁和药业	1,800	10,620.00	0.05
27	002139	拓邦股份	1,000	10,620.00	0.05
28	601801	皖新传媒	1,500	10,395.00	0.05
29	300319	麦捷科技	1,100	10,263.00	0.05
30	300456	赛微电子	600	9,522.00	0.04
31	003006	百亚股份	400	9,480.00	0.04
32	000928	中钢国际	1,700	9,435.00	0.04
33	002063	远光软件	1,800	9,432.00	0.04
34	688568	中科星图	190	9,063.00	0.04
35	002446	盛路通信	1,600	9,040.00	0.04
36	600480	凌云股份	900	8,847.00	0.04
37	600201	生物股份	1,200	8,652.00	0.04
38	001301	尚太科技	200	8,644.00	0.04
39	000065	北方国际	800	8,296.00	0.04
40	300451	创业慧康	2,100	7,266.00	0.03
41	002043	兔宝宝	700	7,259.00	0.03

42	000951	中国重汽	500	7,160.00	0.03
43	002318	久立特材	300	6,999.00	0.03
44	002567	唐人神	1,300	6,968.00	0.03
45	000923	河钢资源	400	6,888.00	0.03
46	300638	广和通	400	6,840.00	0.03
47	000860	顺鑫农业	400	6,696.00	0.03
48	002837	英维克	290	6,203.10	0.03
49	603105	芯能科技	700	6,160.00	0.03
50	002291	遥望科技	1,400	6,020.00	0.03
51	301363	美好医疗	200	5,800.00	0.03
52	603477	巨星农牧	200	5,740.00	0.03
53	002068	黑猫股份	800	5,680.00	0.03
54	300284	苏文科	700	5,656.00	0.03
55	600063	皖维高新	1,600	5,632.00	0.03
56	002402	和而泰	500	5,355.00	0.02
57	688270	臻镭科技	200	5,220.00	0.02
58	300298	三诺生物	200	5,068.00	0.02
59	601222	林洋能源	800	5,016.00	0.02
60	002840	华统股份	300	4,977.00	0.02
61	688518	联赢激光	288	4,809.60	0.02
62	002649	博彦科技	600	4,776.00	0.02
63	688158	优刻得	464	4,746.72	0.02
64	300382	斯莱克	800	4,728.00	0.02
65	002390	信邦制药	1,400	4,634.00	0.02
66	600750	江中药业	200	4,622.00	0.02
67	600496	精工钢构	1,800	4,608.00	0.02
68	600195	中牧股份	600	4,494.00	0.02
69	300587	天铁股份	1,100	4,444.00	0.02
70	002928	华夏航空	700	4,438.00	0.02
71	688351	微电生理	201	4,430.04	0.02
72	600562	国睿科技	300	4,098.00	0.02
73	300113	顺网科技	400	4,096.00	0.02
74	002434	万里扬	800	3,920.00	0.02
75	300232	洲明科技	700	3,654.00	0.02
76	688262	国芯科技	200	3,642.00	0.02
77	000090	天健集团	900	3,618.00	0.02
78	300762	上海瀚讯	200	3,582.00	0.02
79	000543	皖能电力	400	3,540.00	0.02
80	301239	普瑞眼科	100	3,533.00	0.02
81	002158	汉钟精机	200	3,344.00	0.01
82	300294	博雅生物	100	3,300.00	0.01
83	300856	科思股份	100	3,201.00	0.01
84	300151	昌红科技	200	3,164.00	0.01

85	003012	东鹏控股	500	3,055.00	0.01
86	600037	歌华有线	500	2,990.00	0.01
87	688526	科前生物	200	2,938.00	0.01
88	002705	新宝股份	200	2,814.00	0.01
88	002815	崇达技术	300	2,814.00	0.01
89	002978	安宁股份	100	2,786.00	0.01
90	600320	振华重工	800	2,736.00	0.01
91	000810	创维数字	300	2,574.00	0.01
92	300416	苏试试验	200	2,572.00	0.01
93	600821	金开新能	500	2,570.00	0.01
94	600587	新华医疗	160	2,518.40	0.01
95	600125	铁龙物流	400	2,388.00	0.01
96	600059	古越龙山	300	2,382.00	0.01
97	601333	广深铁路	700	2,268.00	0.01
98	002215	诺普信	300	2,235.00	0.01
99	600888	新疆众和	300	2,121.00	0.01
100	002100	天康生物	300	2,079.00	0.01
101	002060	广东建工	600	2,052.00	0.01
102	002948	青岛银行	600	2,022.00	0.01
103	300065	海兰信	300	1,983.00	0.01
104	002212	天融信	400	1,948.00	0.01
105	600138	中青旅	200	1,932.00	0.01
106	600428	中远海特	300	1,836.00	0.01
107	002081	金螳螂	600	1,818.00	0.01
108	002226	江南化工	400	1,792.00	0.01
109	600572	康恩贝	400	1,788.00	0.01
110	603368	柳药集团	100	1,750.00	0.01
111	002127	南极电商	600	1,560.00	0.01
112	002245	蔚蓝锂芯	200	1,550.00	0.01
113	002276	万马股份	200	1,434.00	0.01
114	002697	红旗连锁	300	1,389.00	0.01
115	300755	华致酒行	100	1,366.00	0.01
116	002396	星网锐捷	100	1,321.00	0.01
117	600710	苏美达	100	815.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,107,621.00	14.15
2	601318	中国平安	1,264,468.00	3.50
3	601899	紫金矿业	1,203,592.00	3.34
4	600028	中国石化	1,036,704.00	2.87

5	600019	宝钢股份	947,295.00	2.63
6	601288	农业银行	943,742.00	2.62
7	601668	中国建筑	935,386.00	2.59
8	601398	工商银行	842,428.00	2.33
9	600219	南山铝业	821,872.00	2.28
10	601857	中国石油	821,085.00	2.28
11	603993	洛阳钼业	805,978.00	2.23
12	600406	国电南瑞	805,392.56	2.23
13	300750	宁德时代	773,696.00	2.14
14	600016	民生银行	773,207.00	2.14
15	600887	伊利股份	745,225.00	2.07
16	601728	中国电信	726,089.00	2.01
17	601766	中国中车	712,478.00	1.97
18	601601	中国太保	681,259.00	1.89
19	601816	京沪高铁	645,011.00	1.79
20	601328	交通银行	632,878.00	1.75

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,411,191.00	15.00
2	601899	紫金矿业	1,578,207.00	4.37
3	601288	农业银行	1,348,033.00	3.74
4	600019	宝钢股份	1,262,340.00	3.50
5	601857	中国石油	1,233,631.00	3.42
6	601318	中国平安	1,217,493.00	3.37
7	600028	中国石化	1,130,243.00	3.13
8	600016	民生银行	1,085,985.00	3.01
9	601668	中国建筑	1,063,259.00	2.95
10	603993	洛阳钼业	989,901.00	2.74
11	601398	工商银行	950,128.00	2.63
12	601766	中国中车	940,124.00	2.61
13	600887	伊利股份	937,831.00	2.60
14	600406	国电南瑞	881,873.00	2.44
15	600219	南山铝业	865,620.00	2.40
16	601328	交通银行	816,818.00	2.26
17	600025	华能水电	815,606.00	2.26
18	601728	中国电信	770,912.00	2.14
19	601989	中国重工	757,432.00	2.10
20	601816	京沪高铁	733,214.00	2.03
21	600900	长江电力	722,828.00	2.00

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	106,558,566.77
卖出股票收入（成交）总额	115,134,146.90

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	20,888.57
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	-
8	其他	-
9	合计	20,888.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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 (%)
366	64,870.56	14,672,581.00	61.80	9,070,043.00	38.20

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	6,111,193.00	25.74
2	广发证券股份有限公司	2,619,262.00	11.03
3	中国国际金融股份有	1,555,490.00	6.55

	限公司		
4	珠海海电配网自动化有限公司	1,500,102.00	6.32
5	东方证券股份有限公司	1,025,200.00	4.32
6	刁卓	1,012,319.00	4.26
7	上海竹润投资有限公司一竹润乐其联选8号二期私募证券投资基金	1,000,019.00	4.21
8	金雪雁	944,073.00	3.98
9	方正证券股份有限公司	661,300.00	2.79
10	赵美玉	599,021.00	2.52

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8月23日） 基金份额总额	245,742,624.00
本报告期期初基金份额总额	38,742,624.00
本报告期基金总申购份额	72,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,742,624.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2024 年 6 月 28 日披露了《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于 2024 年 6 月 27 日审议通过了《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。

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 (%)	
中信建投	4	124,664,195.79	56.23	43,105.74	56.22	-
东吴证券	2	97,028,517.88	43.77	33,562.07	43.78	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-

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

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

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(%)
中信建投	-	-	-	-	-	-

东吴证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 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	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-

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	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 1 月 2 日
2	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 1 月 19 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	2024 年 1 月 22 日
5	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 2 月 1 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于增加华宝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	2024 年 2 月 7 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, 四大证券报	2024 年 3 月 5 日
8	《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	2024 年 3 月 19 日
9	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2024 年 3 月 23 日

	值低于 5000 万元的提示性公告》	网站, 证券时报	
10	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2024 年 3 月 26 日
11	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 3 月 29 日
13	《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	2024 年 3 月 29 日
14	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 4 月 10 日
15	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 4 月 17 日
16	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 19 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 4 月 19 日
18	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2024 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	2024 年 5 月 16 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整清算交收条款并修订招募说明书的公告》	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	2024 年 5 月 16 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》	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	2024 年 5 月 27 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》	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	2024 年 5 月 28 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》	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	2024 年 5 月 29 日

23	《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	2024 年 5 月 29 日
24	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 6 月 6 日
25	《银华基金管理股份有限公司关于增加东方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, 证券时报, 上海证券报	2024 年 6 月 14 日
26	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 6 月 21 日
27	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2024 年 6 月 24 日
28	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流流动性服务券商的公告》	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	2024 年 6 月 26 日
29	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告》	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	2024 年 6 月 27 日
30	《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	2024 年 6 月 28 日
31	《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合同 (2024 年 6 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
32	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于 5000 万元的提示性公告》	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	2024 年 6 月 28 日
33	《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	2024 年 6 月 28 日
34	《银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2024 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	2024 年 6 月 28 日
35	《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2024 年 6 月 28 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 (%)
机构	1	20240201-20240201	5,758,752.00	49,760,436.00	52,899,926.00	2,619,262.00	11.03
	1	20240530-20240530	5,758,752.00	49,760,436.00	52,899,926.00	2,619,262.00	11.03
	2	20240418-20240418	0.00	21,000,000.00	21,000,000.00	0.00	0.00
	3	20240102-20240129	6,876,997.00	26,695,552.00	27,461,356.00	6,111,193.00	25.74
	3	20240201-20240417	6,876,997.00	26,695,552.00	27,461,356.00	6,111,193.00	25.74
	3	20240419-20240630	6,876,997.00	26,695,552.00	27,461,356.00	6,111,193.00	25.74

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 2024 年 5 月 16 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整清算交收条款并修订招募说明书的公告》，自 2024 年 5 月 17 日起，调整旗下本基金

招募说明书的清算交收条款。

2、本基金管理人于 2024 年 5 月 27 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金将以通讯方式召开基金份额持有人大会审议《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。

3、本基金管理人于 2024 年 6 月 28 日披露了《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于 2024 年 6 月 27 日审议通过了《关于银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证 800 增强策略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 800 增强策略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 800 增强策略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 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日