

银华中证 2000 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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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

<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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
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 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	58
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	2000 增强 ETF
场内简称	2000 增强 ETF
基金主代码	159555
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	58,462,705.00 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 12 月 12 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：</p> <p>(1) 指数化投资策略</p> <p>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。</p> <p>(2) 量化增强投资策略</p> <p>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 2000 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	杨军智
	联系电话	(010) 58163000	010-60834299
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	010-60836588
传真		(010) 58163027	010-60834004
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		100738	100125
法定代表人		王珠林	张佑君

## 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	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
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	2,024,839.10
本期利润	-860,847.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0113
本期加权平均净值利润率	-1.28%
本期基金份额净值增长率	-16.46%
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	-10,138,722.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1734
期末基金资产净值	48,323,982.95
期末基金份额净值	0.8266
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	-17.34%

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。

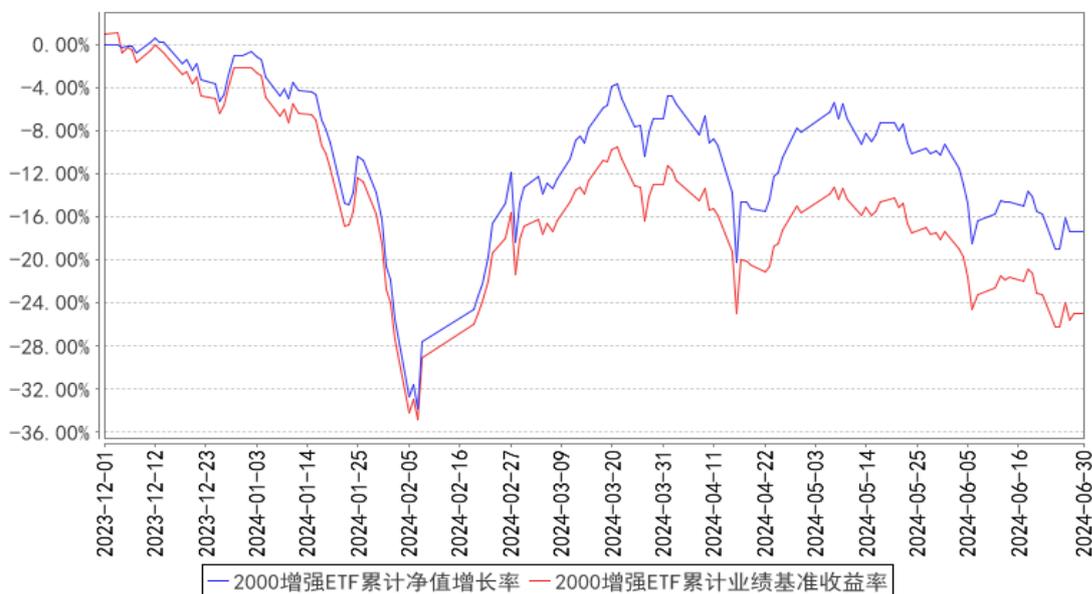
## 3.2 基金净值表现

### 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	-8.89%	1.97%	-9.15%	1.85%	0.26%	0.12%
过去三个月	-11.19%	2.20%	-13.75%	2.01%	2.56%	0.19%
过去六个月	-16.46%	2.65%	-23.28%	2.50%	6.82%	0.15%
自基金合同生效起至今	-17.34%	2.46%	-24.98%	2.33%	7.64%	0.13%

### 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

2000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12月01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12月1日	-	14.5年	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 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。
张亦驰先生	本基金的基金经理	2023 年 12 月 1 日	-	9 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金,历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理,现任量化投资部基金经理。自 2021 年 5 月 25 日至 2023 年 9 月 27 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 5 月 25 日起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 2021 年 5 月 25 日至 2024 年 4 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发起式联接基金基金经理,自 2021 年 11 月 23 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 6 月 20 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 6 月 20 日至

					<p>2023 年 9 月 27 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 2022 年 11 月 21 日起兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 21 日至 2024 年 7 月 16 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 2022 年 11 月 21 日至 2023 年 12 月 19 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 2023 年 4 月 7 日至 2024 年 7 月 16 日兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 7 月 11 日起兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 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，自 2023 年 12 月 4 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 12 月 20 日起兼任银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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 4 月 25 日起兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 6 日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 23 日起兼任银华中证港股通高股息投资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>
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2023 年 12 月 1 日	-	10 年	<p>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。</p>

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 2000 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 0.8266 元；本报告期基金份额净值增长率为-16.46%，业绩比较基准收益率为-23.28%。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本报告期，由银华基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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 2000 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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,171,789.57	2,333,035.53
结算备付金		405,995.97	28.11
存出保证金		274,942.79	-
交易性金融资产	6.4.7.2	46,626,381.69	62,691,719.48
其中：股票投资		46,626,381.69	62,691,719.48
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		-	1,162,386.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,410.15	-
资产总计		48,554,520.17	66,187,169.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		198.74	2,174,467.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,196.38	60,978.22
应付托管费		4,439.29	12,195.65
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	203,702.81	152,164.98
负债合计		230,537.22	2,399,805.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	58,462,705.00	64,462,705.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-10,138,722.05	-675,341.63
净资产合计		48,323,982.95	63,787,363.37
负债和净资产总计		48,554,520.17	66,187,169.33

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8266 元，基金份额总额 58,462,705.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证 2000 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
<b>一、营业总收入</b>		-498,789.75
1. 利息收入		14,130.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,130.81
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）		2,060,747.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,588,793.86
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	471,953.37
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）	6.4.7.20	-2,885,686.10
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	312,018.31
<b>减：二、营业总支出</b>		362,057.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	169,108.43
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,821.71
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	159,127.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		-860,847.00
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填 列）</b>		-860,847.00

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-860,847.00

注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 01 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 2000 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	64,462,705.00	-	-675,341.63	63,787,363.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	64,462,705.00	-	-675,341.63	63,787,363.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,000,000.00	-	-9,463,380.42	-15,463,380.42
(一)、综合收益总额	-	-	-860,847.00	-860,847.00
(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)	-6,000,000.00	-	-8,602,533.42	-14,602,533.42
其中：1. 基金申购款	243,000,000.00	-	-41,337,693.48	201,662,306.52
2. 基金赎回款	-249,000,000.00	-	32,735,160.06	-216,264,839.94
(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	58,462,705.00	-	-10,138,722.05	48,323,982.95

注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 01 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 2000 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]2223 号《关于准予银华中证 2000 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 2000 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 223,454,000.00 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 0592 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2023 年 12 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 223,462,705.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,705.00 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，基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]1111 号核准，本基金 223,462,705.00 份基金份额于 2023 年 12 月 12 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 2000 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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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。本基金的业绩比较基准为:中证 2000 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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有

充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由

基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其

股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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	1,171,789.57
等于：本金	1,171,653.29
加：应计利息	136.28
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	1,171,789.57

##### 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	49,694,062.39	-	46,626,381.69	-3,067,680.70

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	49,694,062.39	-	46,626,381.69	-3,067,680.70

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,410.15
合计	75,410.15

## 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	119,167.45
其中：交易所市场	119,167.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	203,702.81

## 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	64,462,705.00	64,462,705.00
本期申购	243,000,000.00	243,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-249,000,000.00	-249,000,000.00
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	58,462,705.00	58,462,705.00
-----	---------------	---------------

#### 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	-1,470,151.76	794,810.13	-675,341.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,470,151.76	794,810.13	-675,341.63
本期利润	2,024,839.10	-2,885,686.10	-860,847.00
本期基金份额交易产生的变动数	-3,496,560.20	-5,105,973.22	-8,602,533.42
其中：基金申购款	-17,261,298.75	-24,076,394.73	-41,337,693.48
基金赎回款	13,764,738.55	18,970,421.51	32,735,160.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,941,872.86	-7,196,849.19	-10,138,722.05

#### 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	4,235.26
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	8,122.64
其他	1,772.91
合计	14,130.81

#### 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	1,032,979.95

股票投资收益——赎回差价收入	555,813.91
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,588,793.86

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	432,220,919.29
减：卖出股票成本总额	430,619,157.58
减：交易费用	568,781.76
买卖股票差价收入	1,032,979.95

#### 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	216,264,839.94
减：现金支付赎回款总额	85,977,672.94
减：赎回股票成本总额	129,731,353.09
减：交易费用	-
赎回差价收入	555,813.91

#### 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	471,953.37
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	471,953.37

## 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	-2,885,686.10
股票投资	-2,885,686.10
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	-2,885,686.10

## 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	312,018.31
合计	312,018.31

## 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	74,591.75
合计	159,127.11

## 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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信证券	860,773,621.67	100.00

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信证券	297,447.40	100.00	119,167.45	100.00

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

市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	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	169,108.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,627.63
应支付基金管理人的净管理费	155,480.80

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期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	33,821.71

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期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固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

注：无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券	1,171,789.57	4,235.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管，存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行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

金额单位：人民币元

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

				单价		价			额	
002288	*ST 超 华	2024 年 6 月 27 日	重大事 项	0.37	-	-	25,847	62,749.60	9,563.39	-

### 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同责任，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	1,171,789.57	-	-	-	1,171,789.57
结算备付金	405,995.97	-	-	-	405,995.97
存出保证金	274,942.79	-	-	-	274,942.79
交易性金融资产	-	-	-	46,626,381.69	46,626,381.69
其他资产	-	-	-	75,410.15	75,410.15
资产总计	1,852,728.33	-	-	46,701,791.84	48,554,520.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,196.38	22,196.38
应付托管费	-	-	-	4,439.29	4,439.29
应付清算款	-	-	-	198.74	198.74
其他负债	-	-	-	203,702.81	203,702.81
负债总计	-	-	-	230,537.22	230,537.22
利率敏感度缺口	1,852,728.33	-	-	46,471,254.62	48,323,982.95
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	2,333,035.53	-	-	-	2,333,035.53
结算备付金	28.11	-	-	-	28.11
交易性金融资产	-	-	-	62,691,719.48	62,691,719.48
应收清算款	-	-	-	1,162,386.21	1,162,386.21
资产总计	2,333,063.64	-	-	63,854,105.69	66,187,169.33
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	60,978.22	60,978.22
应付托管费	-	-	-	12,195.65	12,195.65
应付清算款	-	-	-	2,174,467.11	2,174,467.11
其他负债	-	-	-	152,164.98	152,164.98
负债总计	-	-	-	2,399,805.96	2,399,805.96
利率敏感度缺口	2,333,063.64	-	-	61,454,299.73	63,787,363.37

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	46,626,381.69	96.49	62,691,719.48	98.28
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	46,626,381.69	96.49	62,691,719.48	98.28

#### 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	2,498,605.73	2,350,024.28

	5%		
	业绩比较基准下降	-2,498,605.73	-2,350,024.28
	5%		

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	46,616,818.30	62,538,269.48
第二层次	9,563.39	153,450.00
第三层次	-	-
合计	46,626,381.69	62,691,719.48

###### 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	46,626,381.69	96.03
	其中：股票	46,626,381.69	96.03
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	1,577,785.54	3.25
8	其他各项资产	350,352.94	0.72
9	合计	48,554,520.17	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	447,408.00	0.93
B	采矿业	34,286.00	0.07
C	制造业	30,631,334.88	63.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	904,140.00	1.87
E	建筑业	435,411.00	0.90
F	批发和零售业	1,374,524.20	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	500,601.00	1.04
H	住宿和餐饮业	132,860.00	0.27
I	信息传输、软件和	5,139,090.17	10.63

	信息技术服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	334,400.00	0.69
L	租赁和商务服务业	1,266,108.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	904,104.75	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	490,814.00	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	442,598.00	0.92
Q	卫生和社会工作	48,825.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	993,412.00	2.06
S	综合	-	-
	合计	44,079,917.00	91.22

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	132,930.00	0.28
C	制造业	1,610,503.55	3.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	127,498.00	0.26
E	建筑业	135,936.00	0.28
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	539,597.14	1.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	2,546,464.69	5.27

### 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	000521	长虹美菱	50,900	385,822.00	0.80
2	002149	西部材料	27,200	379,712.00	0.79
3	300181	佐力药业	23,400	353,808.00	0.73
4	688079	美迪凯	44,931	333,388.02	0.69
5	600105	永鼎股份	86,900	323,268.00	0.67
6	300005	探路者	63,300	317,133.00	0.66
7	002137	实益达	64,000	304,640.00	0.63
8	002386	天原股份	75,000	286,500.00	0.59
9	688418	震有科技	16,566	283,775.58	0.59
10	688371	菲沃泰	28,195	283,077.80	0.59
11	688468	科美诊断	43,545	275,639.85	0.57
12	002073	软控股份	36,200	267,518.00	0.55
13	300061	旗天科技	59,600	267,008.00	0.55
14	002955	鸿合科技	11,400	266,532.00	0.55
15	002441	众业达	34,900	264,542.00	0.55
16	688311	盟升电子	12,758	261,411.42	0.54
17	688207	格灵深瞳	21,910	251,307.70	0.52
18	600987	航民股份	34,500	243,570.00	0.50
19	600617	国新能源	96,160	240,400.00	0.50
20	002380	科远智慧	13,100	239,730.00	0.50
21	000633	合金投资	60,100	236,794.00	0.49
22	002547	春兴精工	97,100	234,982.00	0.49
23	002694	顾地科技	60,700	233,695.00	0.48
24	002362	汉王科技	13,800	229,770.00	0.48
25	300081	恒信东方	48,600	214,812.00	0.44
26	688252	天德钰	14,642	212,748.26	0.44
27	603617	君禾股份	35,300	208,270.00	0.43
28	300531	优博讯	19,900	207,358.00	0.43
29	300959	线上线下	7,300	205,203.00	0.42
30	300565	科信技术	20,400	205,020.00	0.42
31	001223	欧克科技	5,800	204,102.00	0.42

32	688148	芳源股份	48,241	203,094.61	0.42
33	002514	宝馨科技	49,100	202,783.00	0.42
34	688369	致远互联	12,860	202,287.80	0.42
35	002094	青岛金王	112,400	201,196.00	0.42
36	301279	金道科技	8,200	199,916.00	0.41
37	600540	新赛股份	58,600	199,826.00	0.41
38	300436	广生堂	12,500	196,375.00	0.41
39	300643	万通智控	13,900	195,990.00	0.41
40	300340	科恒股份	28,400	195,960.00	0.41
41	688135	利扬芯片	12,187	195,235.74	0.40
42	603668	天马科技	17,020	193,177.00	0.40
43	002533	金杯电工	19,400	193,030.00	0.40
44	002707	众信旅游	33,100	189,994.00	0.39
45	603855	华荣股份	8,500	187,935.00	0.39
46	688579	山大地纬	23,936	187,897.60	0.39
47	688277	天智航	24,047	186,123.78	0.39
48	600479	千金药业	18,300	186,111.00	0.39
49	603158	腾龙股份	26,400	185,856.00	0.38
50	002887	绿茵生态	28,500	185,535.00	0.38
51	000892	欢瑞世纪	73,700	184,250.00	0.38
52	002106	莱宝高科	16,800	183,120.00	0.38
53	300255	常山药业	18,100	181,362.00	0.38
54	600114	东睦股份	12,600	181,314.00	0.38
55	301215	中汽股份	30,900	181,074.00	0.37
56	603998	方盛制药	17,600	180,752.00	0.37
57	301370	国科恒泰	16,600	180,442.00	0.37
58	002350	北京科锐	30,400	178,752.00	0.37
59	300730	科创信息	17,200	178,708.00	0.37
60	300259	新天科技	70,600	178,618.00	0.37
61	001266	宏英智能	8,200	178,104.00	0.37
62	300179	四方达	26,900	177,809.00	0.37
63	688299	长阳科技	13,774	176,169.46	0.36
64	001201	东瑞股份	9,500	176,130.00	0.36
65	002858	力盛体育	16,900	175,760.00	0.36
66	300951	博硕科技	5,600	174,440.00	0.36
67	300195	长荣股份	41,300	173,047.00	0.36
68	603689	皖天然气	21,000	172,620.00	0.36
69	600035	楚天高速	39,900	171,171.00	0.35
70	000900	现代投资	46,700	170,922.00	0.35
71	600238	海南椰岛	22,300	170,149.00	0.35
72	688510	航亚科技	9,227	169,869.07	0.35
73	300976	达瑞电子	3,700	169,645.00	0.35
74	300472	新元科技	38,000	168,340.00	0.35

75	002277	友阿股份	77,800	168,048.00	0.35
76	301181	标榜股份	7,400	167,832.00	0.35
77	300048	合康新能	35,900	166,217.00	0.34
78	301030	仕净科技	6,740	165,938.80	0.34
79	002760	凤形股份	12,500	165,000.00	0.34
80	600661	昂立教育	14,600	163,958.00	0.34
81	301365	矩阵股份	14,850	163,201.50	0.34
82	300946	恒而达	6,100	162,504.00	0.34
83	603070	万控智造	14,500	162,255.00	0.34
84	000949	新乡化纤	47,500	161,500.00	0.33
85	300507	苏奥传感	28,000	161,000.00	0.33
86	301062	上海艾录	15,700	160,297.00	0.33
87	300307	慈星股份	26,900	160,055.00	0.33
88	000912	泸天化	46,100	159,967.00	0.33
89	000663	永安林业	37,900	158,801.00	0.33
90	600368	五洲交通	44,400	158,508.00	0.33
91	600790	轻纺城	49,200	158,424.00	0.33
92	688150	莱特光电	8,166	158,420.40	0.33
93	300174	元力股份	11,600	158,340.00	0.33
94	300217	东方电热	41,800	157,586.00	0.33
95	001229	魅视科技	5,400	157,518.00	0.33
96	688061	灿瑞科技	5,731	157,487.88	0.33
97	600807	济南高新	52,900	157,113.00	0.33
98	301152	天力锂能	6,500	156,585.00	0.32
99	300378	鼎捷软件	9,600	156,192.00	0.32
100	300975	商络电子	17,000	153,680.00	0.32
101	301255	通力科技	4,900	152,782.00	0.32
102	688179	阿拉丁	15,776	152,553.92	0.32
103	688010	福光股份	9,777	152,227.89	0.32
104	002322	理工能科	9,500	152,190.00	0.31
105	603949	雪龙集团	13,500	152,010.00	0.31
106	688722	同益中	13,526	151,355.94	0.31
107	300828	锐新科技	12,600	149,562.00	0.31
108	002935	天奥电子	12,380	149,550.40	0.31
109	002543	万和电气	15,000	149,400.00	0.31
110	603618	杭电股份	34,100	149,358.00	0.31
111	603219	富佳股份	10,100	149,076.00	0.31
112	601789	宁波建工	40,500	149,040.00	0.31
113	300842	帝科股份	3,800	147,440.00	0.31
114	300318	博晖创新	30,100	146,888.00	0.30
115	600551	时代出版	20,700	146,556.00	0.30
116	002140	东华科技	18,900	146,475.00	0.30
117	603633	徕木股份	18,500	146,335.00	0.30

118	601199	江南水务	29,900	145,613.00	0.30
119	600278	东方创业	27,100	145,527.00	0.30
120	000551	创元科技	16,600	144,918.00	0.30
121	300879	大叶股份	10,800	144,504.00	0.30
122	300396	迪瑞医疗	7,100	144,201.00	0.30
123	300791	仙乐健康	5,710	143,892.00	0.30
124	603856	东宏股份	14,100	143,538.00	0.30
125	603701	德宏股份	13,500	142,830.00	0.30
126	301195	北路智控	4,800	142,752.00	0.30
127	688365	光云科技	23,689	142,607.78	0.30
128	603897	长城科技	8,100	142,155.00	0.29
129	603266	天龙股份	8,400	142,128.00	0.29
130	300508	维宏股份	7,300	141,839.00	0.29
131	301161	唯万密封	9,100	141,323.00	0.29
132	301261	恒工精密	3,800	140,866.00	0.29
133	605098	行动教育	3,300	140,646.00	0.29
134	605389	长龄液压	6,700	140,633.00	0.29
135	603629	利通电子	7,600	140,296.00	0.29
136	603999	读者传媒	29,600	140,008.00	0.29
137	002062	宏润建设	40,200	139,896.00	0.29
138	300683	海特生物	6,600	139,656.00	0.29
139	600658	电子城	42,400	139,496.00	0.29
140	300247	融捷健康	57,400	139,482.00	0.29
141	002566	益盛药业	22,700	138,924.00	0.29
142	301159	三维天地	5,200	138,684.00	0.29
143	002031	巨轮智能	61,000	138,470.00	0.29
144	002659	凯文教育	42,200	137,994.00	0.29
145	603507	振江股份	4,200	137,844.00	0.29
146	002685	华东重机	58,500	137,475.00	0.28
147	603138	海量数据	13,100	137,288.00	0.28
148	603217	元利科技	9,700	136,770.00	0.28
149	000505	京粮控股	25,100	136,544.00	0.28
150	000698	沈阳化工	44,900	136,496.00	0.28
151	300384	三联虹普	10,400	136,448.00	0.28
152	000607	华媒控股	44,100	136,269.00	0.28
153	002379	宏创控股	23,000	134,780.00	0.28
154	301299	卓创资讯	3,200	134,400.00	0.28
154	600152	维科技术	28,000	134,400.00	0.28
155	605118	力鼎光电	9,000	134,010.00	0.28
156	603948	建业股份	8,200	133,496.00	0.28
157	000635	英力特	22,800	133,380.00	0.28
158	301073	君亭酒店	7,300	132,860.00	0.27
159	688588	凌志软件	19,371	132,691.35	0.27

160	000803	山高环能	37,900	132,271.00	0.27
161	688112	鼎阳科技	4,889	131,954.11	0.27
162	688590	新致软件	10,222	131,863.80	0.27
163	300969	恒帅股份	1,900	131,347.00	0.27
164	603291	联合水务	10,700	131,182.00	0.27
165	688589	力合微	5,177	130,512.17	0.27
166	688201	信安世纪	11,015	130,087.15	0.27
167	688246	嘉和美康	6,322	128,715.92	0.27
168	603916	苏博特	19,100	128,161.00	0.27
169	688059	华锐精密	2,812	127,608.56	0.26
170	603711	香飘飘	9,200	127,420.00	0.26
171	600819	耀皮玻璃	30,100	127,022.00	0.26
172	688189	南新制药	22,481	126,568.03	0.26
173	600094	大名城	32,600	126,162.00	0.26
174	002905	金逸影视	20,300	125,860.00	0.26
175	603213	镇洋发展	16,800	125,664.00	0.26
176	002765	蓝黛科技	26,700	125,490.00	0.26
177	603090	宏盛股份	7,000	124,740.00	0.26
178	300056	中创环保	15,600	124,020.00	0.26
179	688496	清越科技	13,392	123,742.08	0.26
180	300795	米奥会展	7,000	122,710.00	0.25
181	605198	安德利	4,600	121,440.00	0.25
182	688236	春立医疗	8,543	121,139.74	0.25
183	002852	道道全	16,800	120,960.00	0.25
184	002398	垒知集团	32,500	120,900.00	0.25
185	300688	创业黑马	4,800	119,040.00	0.25
186	002686	亿利达	28,400	118,996.00	0.25
187	600686	金龙汽车	15,800	116,288.00	0.24
188	300245	天玑科技	21,100	113,307.00	0.23
189	688022	瀚川智能	8,249	113,093.79	0.23
190	688687	凯因科技	4,432	113,060.32	0.23
191	301011	华立科技	7,300	112,493.00	0.23
192	605305	中际联合	4,300	110,897.00	0.23
193	300426	唐德影视	16,300	110,514.00	0.23
194	002035	华帝股份	17,600	109,648.00	0.23
195	603255	鼎际得	4,700	109,510.00	0.23
196	300111	向日葵	58,500	109,395.00	0.23
197	300355	蒙草生态	49,600	109,120.00	0.23
198	603918	金桥信息	10,200	106,590.00	0.22
199	300025	华星创业	9,900	104,148.00	0.22
200	605208	永茂泰	16,600	103,418.00	0.21
201	600410	华胜天成	26,400	102,168.00	0.21
202	603901	永创智能	14,400	102,096.00	0.21

203	300848	美瑞新材	6,200	101,928.00	0.21
204	300448	浩云科技	24,200	101,398.00	0.21
205	300718	长盛轴承	7,300	100,886.00	0.21
206	601700	风范股份	22,700	99,653.00	0.21
207	300403	汉宇集团	14,500	99,035.00	0.20
208	300884	狄耐克	11,400	98,268.00	0.20
209	603758	秦安股份	12,800	97,280.00	0.20
210	301257	普蕊斯	3,350	94,637.50	0.20
211	002115	三维通信	18,800	91,368.00	0.19
212	002122	汇洲智能	43,700	91,333.00	0.19
213	600386	北巴传媒	32,700	91,233.00	0.19
214	001234	泰慕士	5,300	90,047.00	0.19
215	300541	先进数通	10,000	89,800.00	0.19
216	688089	嘉必优	6,706	88,787.44	0.18
217	000859	国风新材	25,700	87,894.00	0.18
218	000529	广弘控股	14,900	87,612.00	0.18
219	002786	银宝山新	10,900	87,418.00	0.18
220	688168	安博通	3,230	86,887.00	0.18
221	688595	芯海科技	2,885	86,550.00	0.18
222	300469	信息发展	5,600	85,680.00	0.18
223	688186	广大特材	8,764	85,273.72	0.18
224	300412	迦南科技	29,100	83,808.00	0.17
225	688662	富信科技	3,427	83,618.80	0.17
226	300112	万讯自控	12,000	82,800.00	0.17
227	300986	志特新材	12,100	81,917.00	0.17
228	002630	华西能源	38,500	81,620.00	0.17
229	603336	宏辉果蔬	27,000	81,270.00	0.17
230	300453	三鑫医疗	12,600	80,514.00	0.17
231	002520	日发精机	21,000	79,590.00	0.16
232	000510	新金路	28,200	78,114.00	0.16
233	300571	平治信息	3,700	77,478.00	0.16
234	300787	海能实业	6,240	77,438.40	0.16
235	301198	喜悦智行	9,600	76,896.00	0.16
236	688306	均普智能	18,935	76,876.10	0.16
237	300533	冰川网络	5,500	76,340.00	0.16
238	603630	拉芳家化	7,200	75,672.00	0.16
239	000652	泰达股份	25,200	75,096.00	0.16
240	688077	大地熊	4,707	74,511.81	0.15
241	002248	华东数控	12,400	74,276.00	0.15
242	300578	会畅通讯	5,000	74,000.00	0.15
243	002301	齐心集团	15,300	73,899.00	0.15
244	002420	毅昌科技	16,200	73,872.00	0.15
245	002235	安妮股份	18,300	72,468.00	0.15

246	002752	昇兴股份	14,200	71,852.00	0.15
247	002442	龙星化工	16,700	71,810.00	0.15
248	688259	创耀科技	1,795	71,728.20	0.15
249	002284	亚太股份	10,600	71,656.00	0.15
250	601999	出版传媒	13,700	71,514.00	0.15
251	002662	京威股份	23,300	70,832.00	0.15
252	688613	奥精医疗	5,561	70,791.53	0.15
253	002082	万邦德	16,800	70,728.00	0.15
254	002480	新筑股份	22,300	69,576.00	0.14
255	603360	百傲化学	5,900	69,325.00	0.14
256	300041	回天新材	8,600	68,284.00	0.14
257	003029	吉大正元	3,800	67,602.00	0.14
258	000593	德龙汇能	14,500	67,570.00	0.14
259	688768	容知日新	2,876	67,327.16	0.14
260	000153	丰原药业	12,460	67,034.80	0.14
261	002469	三维化学	11,700	66,690.00	0.14
262	300940	南极光	5,200	66,248.00	0.14
263	603601	再升科技	23,600	65,136.00	0.13
264	603359	东珠生态	17,600	63,888.00	0.13
265	000955	欣龙控股	21,800	63,874.00	0.13
266	002912	中新赛克	3,600	63,792.00	0.13
267	300515	三德科技	6,400	63,168.00	0.13
268	300466	赛摩智能	10,100	61,913.00	0.13
269	002361	神剑股份	19,000	61,560.00	0.13
270	300213	佳讯飞鸿	10,700	60,990.00	0.13
271	301149	隆华新材	6,600	60,984.00	0.13
272	300335	迪森股份	15,700	60,759.00	0.13
273	300161	华中数控	2,700	60,723.00	0.13
274	002571	德力股份	12,100	58,927.00	0.12
275	301051	信濠光电	2,240	58,755.20	0.12
276	002329	皇氏集团	21,600	58,536.00	0.12
277	002286	保龄宝	10,600	58,406.00	0.12
278	300797	钢研纳克	6,300	58,338.00	0.12
279	300071	福石控股	27,700	57,339.00	0.12
280	002527	新时达	9,400	56,306.00	0.12
281	600184	光电股份	6,600	56,166.00	0.12
282	300681	英搏尔	4,300	56,072.00	0.12
283	002919	名臣健康	4,820	55,960.20	0.12
284	002449	国星光电	7,700	54,824.00	0.11
285	301285	鸿日达	2,100	54,789.00	0.11
286	300149	睿智医药	13,400	53,064.00	0.11
287	688292	浩瀚深度	3,394	52,471.24	0.11
288	300011	鼎汉技术	10,400	51,896.00	0.11

289	300493	润欣科技	6,400	51,776.00	0.11
290	002636	金安国纪	8,100	51,435.00	0.11
291	600802	福建水泥	18,500	51,430.00	0.11
292	300098	高新兴	11,600	51,388.00	0.11
293	002863	今飞凯达	12,500	50,875.00	0.11
294	003020	立方制药	2,740	50,087.20	0.10
295	603330	天洋新材	10,200	48,858.00	0.10
296	002524	光正眼科	15,500	48,825.00	0.10
297	002873	新天药业	5,800	48,140.00	0.10
298	002515	金字火腿	12,700	48,133.00	0.10
299	600359	新农开发	8,500	47,515.00	0.10
300	603309	维力医疗	4,300	47,343.00	0.10
301	600573	惠泉啤酒	5,400	47,304.00	0.10
302	688071	华依科技	2,180	47,240.60	0.10
303	300707	威唐工业	3,800	47,044.00	0.10
304	688247	宣泰医药	5,719	47,010.18	0.10
305	002829	星网宇达	3,500	46,865.00	0.10
306	605368	蓝天燃气	3,400	46,376.00	0.10
307	688699	明微电子	1,435	45,561.25	0.09
308	688509	正元地信	15,647	45,219.83	0.09
309	688181	八亿时空	2,381	45,119.95	0.09
310	603366	日出东方	12,600	44,982.00	0.09
311	002160	常铝股份	16,200	43,902.00	0.09
312	300018	中元股份	9,500	43,700.00	0.09
313	300086	康芝药业	12,400	43,524.00	0.09
314	002133	广宇集团	19,400	43,262.00	0.09
315	603227	雪峰科技	6,900	42,780.00	0.09
316	603859	能科科技	2,004	42,124.08	0.09
317	300898	熊猫乳品	2,500	41,775.00	0.09
318	300553	集智股份	1,700	41,633.00	0.09
319	603333	尚纬股份	12,900	40,119.00	0.08
320	300032	金龙机电	12,800	39,808.00	0.08
321	605388	均瑶健康	7,240	39,675.20	0.08
322	300414	中光防雷	6,000	39,660.00	0.08
323	603318	水发燃气	7,000	39,620.00	0.08
324	600071	凤凰光学	2,400	39,192.00	0.08
325	301052	果麦文化	1,900	38,950.00	0.08
326	603028	赛福天	6,900	38,847.00	0.08
327	300978	东箭科技	4,200	38,766.00	0.08
328	300110	华仁药业	12,500	38,625.00	0.08
329	300066	三川智慧	13,500	38,610.00	0.08
330	002995	天地在线	2,900	38,280.00	0.08
331	002084	海鸥住工	15,500	37,975.00	0.08

332	300796	贝斯美	2,600	37,622.00	0.08
333	002817	黄山胶囊	6,900	36,846.00	0.08
334	300306	远方信息	3,900	36,543.00	0.08
335	300921	南凌科技	2,100	36,372.00	0.08
336	300939	秋田微	1,200	36,168.00	0.07
337	300615	欣天科技	3,700	35,409.00	0.07
338	603173	福斯达	1,600	34,736.00	0.07
339	300605	恒锋信息	3,800	34,428.00	0.07
340	000655	金岭矿业	6,200	34,286.00	0.07
341	600135	乐凯胶片	7,000	34,160.00	0.07
342	600526	菲达环保	9,200	34,132.00	0.07
343	600619	海立股份	6,600	34,122.00	0.07
344	002909	集泰股份	8,300	34,030.00	0.07
345	603676	卫信康	4,200	33,642.00	0.07
346	002365	永安药业	4,600	33,212.00	0.07
347	600829	人民同泰	5,800	32,538.00	0.07
348	002825	纳尔股份	5,200	32,396.00	0.07
349	002666	德联集团	8,900	32,218.00	0.07
350	000589	贵州轮胎	6,300	31,941.00	0.07
351	600237	铜峰电子	6,100	31,842.00	0.07
352	688227	品高股份	2,609	31,594.99	0.07
353	000757	浩物股份	12,500	31,375.00	0.06
354	000501	武商集团	4,600	30,682.00	0.06
355	301318	维海德	1,100	30,217.00	0.06
356	301320	豪江智能	2,000	30,040.00	0.06
357	688358	祥生医疗	1,145	29,735.65	0.06
358	600525	长园集团	6,800	28,968.00	0.06
359	301169	零点有数	1,000	28,800.00	0.06
360	603697	有友食品	4,900	28,420.00	0.06
361	600693	东百集团	10,000	28,100.00	0.06
362	603848	好太太	2,200	27,698.00	0.06
363	605068	明新旭腾	2,100	27,678.00	0.06
364	600429	三元股份	7,300	27,229.00	0.06
365	301382	蜂助手	1,500	27,135.00	0.06
366	301310	鑫宏业	1,080	26,028.00	0.05
367	301102	兆讯传媒	2,200	25,938.00	0.05
368	301139	元道通信	1,200	25,812.00	0.05
369	000045	深纺织 A	3,200	25,664.00	0.05
370	600533	栖霞建设	13,000	25,480.00	0.05
371	001319	铭科精技	1,500	24,450.00	0.05
372	605199	葫芦娃	2,500	24,375.00	0.05
373	300622	博士眼镜	2,000	24,340.00	0.05
374	300713	英可瑞	2,000	24,240.00	0.05

375	600108	亚盛集团	10,100	23,937.00	0.05
376	603106	恒银科技	5,600	23,856.00	0.05
377	301408	华人健康	2,300	23,529.00	0.05
378	000055	方大集团	6,600	23,100.00	0.05
378	300440	运达科技	4,400	23,100.00	0.05
379	301360	荣旗科技	500	21,625.00	0.04
380	301396	宏景科技	1,100	21,461.00	0.04
381	301197	工大科雅	1,600	20,992.00	0.04
382	002344	海宁皮城	6,700	20,502.00	0.04
383	301313	凡拓数创	1,000	20,350.00	0.04
384	001313	粤海饲料	2,700	20,304.00	0.04
385	300993	玉马遮阳	2,200	19,668.00	0.04
386	300989	蕾奥规划	1,600	19,568.00	0.04
387	300138	晨光生物	2,300	19,389.00	0.04
388	301270	汉仪股份	800	19,304.00	0.04
389	605398	新炬网络	900	18,441.00	0.04
390	300625	三雄极光	1,700	17,833.00	0.04
391	300275	梅安森	1,700	16,949.00	0.04
392	300892	品渥食品	1,100	15,004.00	0.03
393	688678	福立旺	1,362	14,750.46	0.03
394	603917	合力科技	1,300	14,066.00	0.03
395	002367	康力电梯	2,000	11,540.00	0.02
396	300781	因赛集团	200	10,436.00	0.02
397	688698	伟创电气	357	9,628.29	0.02
398	605188	国光连锁	1,100	8,525.00	0.02
399	603387	基蛋生物	1,000	7,760.00	0.02
400	600735	新华锦	1,500	5,745.00	0.01
401	601566	九牧王	600	5,052.00	0.01
402	002330	得利斯	1,300	4,745.00	0.01
403	002599	盛通股份	700	3,500.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002938	鹏鼎控股	4,900	194,824.00	0.40
2	002384	东山精密	9,200	190,440.00	0.39
3	002475	立讯精密	4,500	176,895.00	0.37
4	601728	中国电信	24,700	151,905.00	0.31
5	300408	三环集团	5,000	145,950.00	0.30
6	600875	东方电气	7,800	143,910.00	0.30
7	002180	纳思达	5,300	140,026.00	0.29
8	601668	中国建筑	25,600	135,936.00	0.28
9	688088	虹软科技	4,699	135,613.14	0.28
10	002128	电投能源	6,300	132,930.00	0.28

11	002034	旺能环境	9,800	127,498.00	0.26
12	688111	金山办公	558	126,945.00	0.26
13	002121	科陆电子	33,400	126,586.00	0.26
14	002123	梦网科技	17,800	125,134.00	0.26
15	300132	青松股份	34,700	120,756.00	0.25
16	301155	海力风电	2,900	116,667.00	0.24
17	601865	福莱特	5,800	116,580.00	0.24
18	688136	科兴制药	3,791	63,537.16	0.13
19	605500	森林包装	6,000	36,900.00	0.08
20	603181	皇马科技	3,100	27,869.00	0.06
21	002288	*ST 超华	25,847	9,563.39	0.02

## 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	603220	中贝通信	1,881,662.00	2.95
2	600757	长江传媒	1,517,477.00	2.38
3	603949	雪龙集团	1,494,440.00	2.34
4	603496	恒为科技	1,493,921.00	2.34
5	600105	永鼎股份	1,473,284.10	2.31
6	688319	欧林生物	1,414,916.14	2.22
7	688365	光云科技	1,413,508.04	2.22
8	688369	致远互联	1,310,640.69	2.05
9	000766	通化金马	1,243,936.00	1.95
10	688687	凯因科技	1,240,236.45	1.94
11	688588	凌志软件	1,184,432.96	1.86
12	002827	高争民爆	1,168,978.00	1.83
13	603429	集友股份	1,155,665.00	1.81
14	688371	菲沃泰	1,140,712.11	1.79
15	688030	山石网科	1,111,119.21	1.74
16	688378	奥来德	1,067,748.67	1.67
17	600035	楚天高速	1,065,739.00	1.67
18	688148	芳源股份	1,058,607.28	1.66
19	688311	盟升电子	1,018,306.41	1.60
20	600133	东湖高新	1,014,305.00	1.59

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603220	中贝通信	2,345,900.00	3.68

2	603496	恒为科技	1,746,617.00	2.74
3	600757	长江传媒	1,687,269.00	2.65
4	002827	高争民爆	1,643,364.00	2.58
5	603949	雪龙集团	1,578,336.00	2.47
6	688319	欧林生物	1,561,085.36	2.45
7	600133	东湖高新	1,335,346.35	2.09
8	688365	光云科技	1,239,312.99	1.94
9	603787	新日股份	1,129,718.00	1.77
10	688687	凯因科技	1,125,571.69	1.76
11	603429	集友股份	1,109,406.00	1.74
12	688378	奥来德	1,104,647.50	1.73
13	688369	致远互联	1,095,056.32	1.72
14	688030	山石网科	1,079,761.46	1.69
15	600237	铜峰电子	1,051,661.50	1.65
16	688588	凌志软件	1,045,346.51	1.64
17	603283	赛腾股份	1,042,220.00	1.63
18	601020	华钰矿业	1,031,313.00	1.62
19	600105	永鼎股份	1,024,008.00	1.61
20	688225	亚信安全	992,727.42	1.56

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	428,552,702.38
卖出股票收入（成交）总额	432,220,919.29

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	274,942.79
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	75,410.15
8	其他	-
9	合计	350,352.94

### 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 (%)
1,229	47,569.33	10,703,617.00	18.31	47,759,088.00	81.69

### 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	中国国际金融股份有限公司	4,548,659.00	7.78
2	石梅	2,590,577.00	4.43
3	方正证券股份有限公司	2,529,392.00	4.33
4	娄爱芹	2,430,070.00	4.16
5	张旭言	1,996,154.00	3.41
6	安保文	1,970,134.00	3.37
7	广发证券股份有限公司	1,735,168.00	2.97
8	金小艳	1,505,117.00	2.57
9	王光勇	1,110,068.00	1.90
10	罗辛辛	1,099,074.00	1.88

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 12 月 1 日）	
基金份额总额	223,462,705.00

本报告期期初基金份额总额	64,462,705.00
本报告期基金总申购份额	243,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	249,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,462,705.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	

			(%)		(%)	
中信证券	5	860,773,621.67	100.00	297,447.40	100.00	-

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
2	《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, 证券时报, 上海证券报	2024年2月26日
3	《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
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3月19日
5	《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
6	《关于银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	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4月15日

7	《银华中证 2000 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
8	《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
9	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分证券投资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, 证券时报, 上海证券报	2024 年 5 月 23 日
10	《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
11	《银华中证 2000 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 6 月 20 日
12	《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, 四大证券报	2024 年 6 月 20 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 6 月 28 日
14	《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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 6 月 20 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 6 月 21 日起，调整旗下本基金招募说明书的清算交收条款。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证 2000 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 2000 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 2000 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 2000 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日