

银华中证 1000 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61

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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000 增强 ETF
场内简称	1000 增强 ETF
基金主代码	159677
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 24 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	92,904,091.00 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	2022 年 12 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>本基金标的指数为中证 1000 指数。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 1000 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	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	王小飞
	联系电话	(010)58163000	021-60637103
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	021-60637228	
传真	(010)58163027	021-60635778	
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	100738	100033	
法定代表人	王珠林	张金良	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-4,053,819.61
本期利润	-7,996,369.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0835
本期加权平均净值利润率	-9.37%
本期基金份额净值增长率	-13.96%
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	-14,954,954.45
期末可供分配基金份额利润	-0.1610
期末基金资产净值	77,949,136.55
期末基金份额净值	0.8390
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	-16.10%

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。

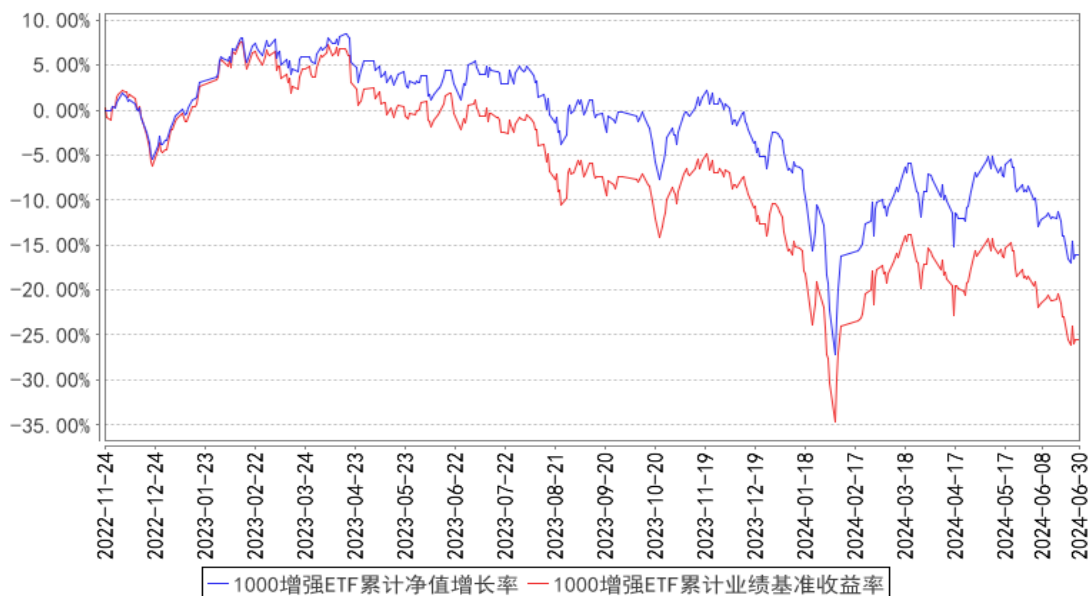
3.2 基金净值表现

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	-8.38%	1.37%	-8.58%	1.43%	0.20%	-0.06%
过去三个月	-7.76%	1.46%	-10.02%	1.49%	2.26%	-0.03%
过去六个月	-13.96%	1.88%	-16.84%	1.97%	2.88%	-0.09%
过去一年	-20.11%	1.47%	-25.84%	1.55%	5.73%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-16.10%	1.25%	-25.46%	1.34%	9.36%	-0.09%

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

1000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：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，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、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券

投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华中证沪港深 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	2022年11月24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>

					<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。</p>
王帅先生	本基金的基金经理	2022 年 11 月 24 日	2024 年 1 月 23 日	11.5 年	<p>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>

				<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	2022 年 11 月 24 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 1000 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 0.8390 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.96%，业绩比较基准收益率为-16.84%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 6.5% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 1000 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	4,663,702.42	1,803,080.73
结算备付金		1,781,763.14	469,578.46
存出保证金		609,082.15	121,201.22
交易性金融资产	6.4.7.2	71,140,543.38	82,736,659.53
其中：股票投资		71,140,543.38	82,736,659.53
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		78,195,091.09	85,130,519.94
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		31,184.26	36,425.99
应付托管费		6,236.85	7,285.21
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	208,533.43	348,061.48
负债合计		245,954.54	391,772.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	92,904,091.00	86,904,091.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-14,954,954.45	-2,165,343.74
净资产合计		77,949,136.55	84,738,747.26
负债和净资产总计		78,195,091.09	85,130,519.94

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8390 元，基金份额总额 92,904,091.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 1000 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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-7,638,867.68	36,292,282.23
1. 利息收入		19,137.21	28,724.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,137.21	28,724.77
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）		-3,717,984.73	12,319,248.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,734,611.33	10,896,984.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	249,613.04	-
股利收益	6.4.7.19	767,013.56	1,422,264.41
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	-3,942,549.95	22,890,525.33
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	2,529.79	1,053,783.18
减：二、营业总支出		357,501.88	529,238.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	215,789.74	337,609.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,157.91	67,521.78
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		1,451.90	-
8. 其他费用	6.4.7.23	97,102.33	124,107.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,996,369.56	35,763,043.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,996,369.56	35,763,043.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,996,369.56	35,763,043.77

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 1000 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	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,000,000.00	-	-12,789,610.71	-6,789,610.71
(一)、综合收益总额	-	-	-7,996,369.56	-7,996,369.56
(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	-	-4,793,241.15	1,206,758.85
其中：1. 基金申购款	159,000,000.00	-	-23,345,550.96	135,654,449.04
2. 基金赎回款	-153,000,000.00	-	18,552,309.81	-134,447,690.19
(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	92,904,091.00	-	-14,954,954.45	77,949,136.55
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	510,000,000.00	-	47,374,025.10	557,374,025.10

(一)、综合收益总额	-	-	35,763,043.77	35,763,043.77
(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)	510,000,000.00	-	11,610,981.33	521,610,981.33
其中：1. 基金申购款	756,000,000.00	-	21,090,037.48	777,090,037.48
2. 基金赎回款	-246,000,000.00	-	-9,479,056.15	-255,479,056.15
(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	767,904,091.00	-	38,540,818.16	806,444,909.16

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 1000 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[2022]2601 号《关于准予银华中证 1000 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 1000 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 1,250,861,344.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0951 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2022 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,250,904,091.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 42,747.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]1122 号核准,本基金 1,250,904,091.00 份基金份额于 2022 年 12 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 1000 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 1000 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 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	4,663,702.42
等于：本金	4,663,261.78
加：应计利息	440.64
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	4,663,702.42

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		77,111,318.72	-	71,140,543.38	-5,970,775.34
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		77,111,318.72	-	71,140,543.38	-5,970,775.34

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,153,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,153,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,153,800.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	5.00	4,858,000.00	-295,800.00
合计				-295,800.00
减：可抵销期货暂收款				-295,800.00
净额				0.00

注：当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于2024年06月30日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零

元。

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	91,567.47
其中：交易所市场	91,567.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	116,965.96
合计	208,533.43

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	86,904,091.00	86,904,091.00
本期申购	159,000,000.00	159,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-153,000,000.00	-153,000,000.00
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	92,904,091.00	92,904,091.00

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	5,476,601.91	-7,641,945.65	-2,165,343.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,476,601.91	-7,641,945.65	-2,165,343.74
本期利润	-4,053,819.61	-3,942,549.95	-7,996,369.56
本期基金份额交易产生的变动数	1,966,943.85	-6,760,185.00	-4,793,241.15
其中：基金申购款	1,749,755.70	-25,095,306.66	-23,345,550.96
基金赎回款	217,188.15	18,335,121.66	18,552,309.81
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	3,389,726.15	-18,344,680.60	-14,954,954.45

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		6,902.87
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		11,951.93
其他		282.41
合计		19,137.21

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		-3,532,629.07
股票投资收益——赎回差价收入		-1,201,982.26
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		-4,734,611.33

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		395,205,637.02
减：卖出股票成本总额		398,218,482.54
减：交易费用		519,783.55
买卖股票差价收入		-3,532,629.07

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		134,447,690.19
减：现金支付赎回款总额		69,175,471.19
减：赎回股票成本总额		66,474,201.26
减：交易费用		-
赎回差价收入		-1,201,982.26

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	249,613.04

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	767,013.56
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	767,013.56

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	-3,646,749.95
股票投资	-3,646,749.95
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	-295,800.00
权证投资	-
期货投资	-295,800.00
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	-3,942,549.95

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	2,529.79
合计	2,529.79

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	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	135.00
其他	9,945.85
合计	97,102.33

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
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
西南证券	121,636,030.77	15.46	473,166,888.21	42.90

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 (%)
西南证券	41,618.45	15.32	10,159.28	11.09
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
西南证券	245,625.60	29.56	154,920.29	39.70

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	215,789.74	337,609.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,232.60	26,285.03
应支付基金管理人的净管理费	202,557.14	311,324.32

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,157.91	67,521.78

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,663,702.42	6,902.87	43,055,457.47	9,896.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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	4,663,702.42	-	-	-	4,663,702.42
结算备付金	1,781,763.14	-	-	-	1,781,763.14
存出保证金	609,082.15	-	-	-	609,082.15
交易性金融资产	-	-	-	71,140,543.38	71,140,543.38
资产总计	7,054,547.71	-	-	71,140,543.38	78,195,091.09

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,184.26	31,184.26
应付托管费	-	-	-	6,236.85	6,236.85
其他负债	-	-	-	208,533.43	208,533.43
负债总计	-	-	-	245,954.54	245,954.54
利率敏感度缺口	7,054,547.71	-	-	70,894,588.84	77,949,136.55
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	1,803,080.73	-	-	-	1,803,080.73
结算备付金	469,578.46	-	-	-	469,578.46
存出保证金	121,201.22	-	-	-	121,201.22
交易性金融资产	-	-	-	82,736,659.53	82,736,659.53
资产总计	2,393,860.41	-	-	82,736,659.53	85,130,519.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,425.99	36,425.99
应付托管费	-	-	-	7,285.21	7,285.21
其他负债	-	-	-	348,061.48	348,061.48
负债总计	-	-	-	391,772.68	391,772.68
利率敏感度缺口	2,393,860.41	-	-	82,344,886.85	84,738,747.26

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	71,140,543.38	91.27	82,736,659.53	97.64
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	71,140,543.38	91.27	82,736,659.53	97.64

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%	3,649,497.34	3,805,662.67
业绩比较基准下降 5%	-3,649,497.34	-3,805,662.67	

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	71,140,543.38	82,407,742.09
第二层次	-	56,086.52
第三层次	-	272,830.92
合计	71,140,543.38	82,736,659.53

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	71,140,543.38	90.98
	其中：股票	71,140,543.38	90.98
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	6,445,465.56	8.24
8	其他各项资产	609,082.15	0.78
9	合计	78,195,091.09	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	198,394.00	0.25
B	采矿业	2,066,794.00	2.65
C	制造业	41,918,759.93	53.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,377,711.72	3.05
E	建筑业	692,771.00	0.89
F	批发和零售业	3,128,181.10	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,307,966.40	4.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,616,404.84	8.49
J	金融业	1,603,492.95	2.06
K	房地产业	1,264,859.00	1.62
L	租赁和商务服务业	981,111.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	683,101.93	0.88

N	水利、环境和公共设施管理业	626,982.20	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	198,368.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	921,344.00	1.18
S	综合	-	-
	合计	66,586,242.07	85.42

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	228,119.00	0.29
C	制造业	2,997,820.19	3.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	199,655.20	0.26
E	建筑业	163,996.00	0.21
F	批发和零售业	79,621.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	51,082.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	382,436.00	0.49
J	金融业	130,506.00	0.17
K	房地产业	7,620.00	0.01
L	租赁和商务服务业	46,777.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	86,593.92	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	20,088.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	57,273.00	0.07
Q	卫生和社会工作	10,360.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	80,386.00	0.10
S	综合	11,968.00	0.02
	合计	4,554,301.31	5.84

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	002249	大洋电机	110,000	520,300.00	0.67
2	603393	新天然气	14,100	489,834.00	0.63
3	601311	骆驼股份	58,700	470,774.00	0.60
4	002354	天娱数科	153,800	459,862.00	0.59
5	002267	陕天然气	60,000	453,600.00	0.58
6	002545	东方铁塔	62,400	424,944.00	0.55
7	603328	依顿电子	53,900	423,654.00	0.54
8	300369	绿盟科技	82,100	419,531.00	0.54
9	600007	中国国贸	19,100	419,436.00	0.54
10	003006	百亚股份	17,400	412,380.00	0.53
11	000030	富奥股份	79,900	392,309.00	0.50
12	601326	秦港股份	122,100	387,057.00	0.50
13	601702	华峰铝业	21,100	385,286.00	0.49
14	600320	振华重工	111,700	382,014.00	0.49
15	600125	铁龙物流	63,000	376,110.00	0.48
16	300587	天铁股份	90,600	366,024.00	0.47
17	600273	嘉化能源	51,000	364,140.00	0.47
18	000795	英洛华	65,500	362,870.00	0.47
19	002291	遥望科技	84,300	362,490.00	0.47
20	300323	华灿光电	79,700	346,695.00	0.44
21	002697	红旗连锁	74,000	342,620.00	0.44
22	688232	新点软件	17,078	336,778.16	0.43
23	002416	爱施德	37,600	332,760.00	0.43
24	600618	氯碱化工	37,700	331,006.00	0.42
25	688158	优刻得	32,222	329,631.06	0.42
26	600888	新疆众和	46,500	328,755.00	0.42
27	600717	天津港	76,200	325,374.00	0.42
28	000415	渤海租赁	127,400	324,870.00	0.42
29	002745	木林森	40,000	322,400.00	0.41
30	002701	奥瑞金	77,300	321,568.00	0.41
31	600012	皖通高速	23,000	321,310.00	0.41
32	002550	千红制药	59,200	319,088.00	0.41
33	002488	金固股份	72,100	316,519.00	0.41
34	002332	仙琚制药	27,700	316,057.00	0.41
35	601369	陕鼓动力	39,100	313,582.00	0.40
36	601963	重庆银行	39,900	309,225.00	0.40
37	002837	英维克	14,280	305,449.20	0.39
38	688166	博瑞医药	8,594	300,790.00	0.39

39	600158	中体产业	38,900	299,141.00	0.38
40	002126	银轮股份	17,000	295,970.00	0.38
41	000403	派林生物	11,100	295,926.00	0.38
42	601801	皖新传媒	42,700	295,911.00	0.38
43	600458	时代新材	29,100	293,910.00	0.38
44	300633	开立医疗	7,400	292,892.00	0.38
45	002948	青岛银行	85,900	289,483.00	0.37
46	300624	万兴科技	5,399	286,524.93	0.37
47	000950	重药控股	58,700	285,869.00	0.37
48	002100	天康生物	40,600	281,358.00	0.36
49	300573	兴齐眼药	1,700	278,800.00	0.36
50	300085	银之杰	34,400	277,952.00	0.36
51	002068	黑猫股份	38,900	276,190.00	0.35
52	000550	江铃汽车	12,500	271,375.00	0.35
53	002453	华软科技	63,100	270,699.00	0.35
54	002214	大立科技	23,900	269,592.00	0.35
55	002978	安宁股份	9,600	267,456.00	0.34
56	000029	深深房 A	25,100	266,813.00	0.34
57	600452	涪陵电力	21,000	266,070.00	0.34
58	002461	珠江啤酒	35,800	265,636.00	0.34
59	601222	林洋能源	41,900	262,713.00	0.34
60	688173	希荻微	23,796	262,469.88	0.34
61	002646	天佑德酒	25,300	258,819.00	0.33
62	603025	大豪科技	18,600	257,052.00	0.33
63	002737	葵花药业	10,900	254,842.00	0.33
64	300679	电连技术	6,300	253,449.00	0.33
65	603323	苏农银行	52,100	250,601.00	0.32
66	688575	亚辉龙	10,669	248,801.08	0.32
67	000927	中国铁物	101,900	242,522.00	0.31
68	688209	英集芯	19,412	240,902.92	0.31
69	600710	苏美达	29,500	240,425.00	0.31
70	002003	伟星股份	19,000	238,450.00	0.31
71	000582	北部湾港	32,000	238,080.00	0.31
72	600782	新钢股份	71,700	238,044.00	0.31
73	688270	臻镭科技	9,067	236,648.70	0.30
74	688380	中微半导	14,151	236,604.72	0.30
75	601101	昊华能源	25,700	236,183.00	0.30
76	600971	恒源煤电	19,700	235,218.00	0.30
77	688711	宏微科技	14,603	234,524.18	0.30
78	002048	宁波华翔	18,100	234,214.00	0.30
79	600395	盘江股份	38,900	233,789.00	0.30
80	688046	药康生物	22,713	232,126.86	0.30
81	300065	海兰信	35,100	232,011.00	0.30

82	002544	普天科技	12,400	231,756.00	0.30
83	002635	安洁科技	15,000	231,600.00	0.30
84	600877	电科芯片	21,500	230,480.00	0.30
85	301268	铭利达	14,700	228,585.00	0.29
86	002807	江阴银行	60,200	226,954.00	0.29
87	600997	开滦股份	33,000	226,380.00	0.29
88	688088	虹软科技	7,831	226,002.66	0.29
89	603132	金徽股份	16,300	224,288.00	0.29
90	603279	景津装备	10,300	223,407.00	0.29
91	002773	康弘药业	10,300	222,995.00	0.29
92	688023	安恒信息	5,528	221,175.28	0.28
93	600491	龙元建设	80,300	220,022.00	0.28
94	688315	诺禾致源	20,072	219,186.24	0.28
95	688033	天宜上佳	36,531	219,186.00	0.28
96	688206	概伦电子	14,746	218,978.10	0.28
97	002088	鲁阳节能	18,000	217,620.00	0.28
98	603008	喜临门	12,500	216,625.00	0.28
99	600993	马应龙	8,100	216,027.00	0.28
100	002498	汉缆股份	65,500	215,495.00	0.28
101	600773	西藏城投	20,800	214,656.00	0.28
102	002123	梦网科技	30,500	214,415.00	0.28
103	000567	海德股份	38,095	213,712.95	0.27
104	300382	斯莱克	36,100	213,351.00	0.27
105	600285	羚锐制药	8,800	213,048.00	0.27
106	603123	翠微股份	35,800	212,652.00	0.27
107	000028	国药一致	6,570	211,751.10	0.27
108	688091	上海谊众	9,373	211,736.07	0.27
109	603299	苏盐井神	22,200	210,900.00	0.27
110	002320	海峡股份	40,600	209,496.00	0.27
111	601677	明泰铝业	18,100	209,236.00	0.27
112	002020	京新药业	19,800	207,306.00	0.27
113	601952	苏垦农发	22,800	205,656.00	0.26
114	002237	恒邦股份	17,600	202,576.00	0.26
114	600835	上海机电	17,600	202,576.00	0.26
115	600420	国药现代	18,900	201,852.00	0.26
116	600575	淮河能源	51,700	201,113.00	0.26
117	688707	振华新材	20,623	200,868.02	0.26
118	002004	华邦健康	52,400	199,120.00	0.26
119	600761	安徽合力	9,200	199,088.00	0.26
120	600110	诺德股份	65,200	198,860.00	0.26
121	600662	外服控股	49,400	198,094.00	0.25
122	300134	大富科技	28,900	197,098.00	0.25
123	688556	高测股份	16,478	195,923.42	0.25

124	603595	东尼电子	9,500	195,605.00	0.25
125	002034	旺能环境	14,900	193,849.00	0.25
126	600295	鄂尔多斯	19,500	193,440.00	0.25
127	301015	百洋医药	8,100	190,593.00	0.24
128	002928	华夏航空	29,700	188,298.00	0.24
129	300119	瑞普生物	13,800	187,956.00	0.24
130	002456	欧菲光	24,000	187,440.00	0.24
131	000758	中色股份	36,600	185,928.00	0.24
132	301155	海力风电	4,600	185,058.00	0.24
133	002782	可立克	16,700	185,036.00	0.24
134	603567	珍宝岛	17,500	184,275.00	0.24
135	601609	金田股份	32,400	183,384.00	0.24
136	601126	四方股份	9,500	182,590.00	0.23
137	688110	东芯股份	9,453	180,268.71	0.23
138	000913	钱江摩托	11,400	179,664.00	0.23
139	300741	华宝股份	11,600	176,784.00	0.23
140	600507	方大特钢	47,200	176,528.00	0.23
141	688680	海优新材	6,132	176,233.68	0.23
142	002245	蔚蓝锂芯	22,600	175,150.00	0.22
143	688526	科前生物	11,567	169,919.23	0.22
144	300702	天宇股份	9,400	167,602.00	0.22
145	600787	中储股份	34,800	167,388.00	0.21
146	603489	八方股份	6,200	167,276.00	0.21
147	600562	国睿科技	12,200	166,652.00	0.21
148	300428	立中集团	8,800	163,592.00	0.21
149	002139	拓邦股份	15,300	162,486.00	0.21
150	300319	麦捷科技	17,400	162,342.00	0.21
151	605333	沪光股份	5,800	161,530.00	0.21
152	002063	远光软件	30,820	161,496.80	0.21
153	603583	捷昌驱动	7,800	158,964.00	0.20
154	002421	达实智能	68,000	158,440.00	0.20
155	603678	火炬电子	6,400	158,016.00	0.20
156	002006	精工科技	11,700	157,014.00	0.20
157	301087	可孚医疗	4,600	155,940.00	0.20
158	688127	蓝特光学	8,409	154,641.51	0.20
159	600201	生物股份	21,400	154,294.00	0.20
160	600017	日照港	57,500	153,525.00	0.20
161	600456	宝钛股份	6,000	153,180.00	0.20
162	603612	索通发展	12,000	153,120.00	0.20
163	002402	和而泰	14,200	152,082.00	0.20
164	688381	帝奥微	7,733	150,638.84	0.19
165	002446	盛路通信	26,600	150,290.00	0.19
166	300463	迈克生物	13,200	150,216.00	0.19

167	600572	康恩贝	33,600	150,192.00	0.19
168	600610	中毅达	37,300	148,454.00	0.19
169	600037	歌华有线	24,800	148,304.00	0.19
170	601069	西部黄金	12,500	145,375.00	0.19
171	301090	华润材料	22,000	144,760.00	0.19
172	300783	三只松鼠	6,600	144,342.00	0.19
173	002649	博彦科技	17,900	142,484.00	0.18
174	300638	广和通	8,300	141,930.00	0.18
175	002176	江特电机	17,400	141,810.00	0.18
176	603236	移远通信	3,000	140,190.00	0.18
177	603013	亚普股份	10,400	140,088.00	0.18
178	603919	金徽酒	7,700	139,909.00	0.18
179	002891	中宠股份	6,700	139,829.00	0.18
180	600602	云赛智联	12,200	134,688.00	0.17
181	000951	中国重汽	9,400	134,608.00	0.17
182	000543	皖能电力	15,100	133,635.00	0.17
183	600409	三友化工	26,500	133,030.00	0.17
184	600475	华光环能	15,000	130,650.00	0.17
184	603229	奥翔药业	13,000	130,650.00	0.17
185	688798	艾为电子	2,266	128,300.92	0.16
186	600651	飞乐音响	45,500	125,580.00	0.16
187	002541	鸿路钢构	7,400	125,578.00	0.16
188	601921	浙版传媒	16,400	125,296.00	0.16
189	000968	蓝焰控股	19,600	124,656.00	0.16
190	000035	中国天楹	27,500	124,575.00	0.16
191	601975	招商南油	34,400	123,496.00	0.16
192	002549	凯美特气	24,000	122,640.00	0.16
193	600223	福瑞达	17,300	122,311.00	0.16
194	603906	龙蟠科技	15,700	122,303.00	0.16
195	300143	盈康生命	16,230	122,211.90	0.16
196	300470	中密控股	3,600	121,716.00	0.16
197	000034	神州数码	5,300	121,317.00	0.16
198	300348	长亮科技	17,500	119,350.00	0.15
199	600688	上海石化	44,900	117,189.00	0.15
200	000650	仁和药业	19,700	116,230.00	0.15
201	600063	皖维高新	33,000	116,160.00	0.15
202	605222	起帆电缆	7,300	111,982.00	0.14
203	688383	新益昌	2,122	110,577.42	0.14
204	301078	孩子王	21,700	109,802.00	0.14
205	002428	云南锗业	10,100	109,686.00	0.14
206	301177	迪阿股份	5,800	107,880.00	0.14
207	002215	诺普信	14,400	107,280.00	0.14
208	300476	胜宏科技	3,300	106,458.00	0.14

209	600059	古越龙山	13,400	106,396.00	0.14
210	603530	神马电力	4,000	105,960.00	0.14
211	688372	伟测科技	2,651	104,263.83	0.13
212	688321	微芯生物	5,879	103,470.40	0.13
213	688439	振华风光	1,557	103,462.65	0.13
214	300458	全志科技	4,400	103,444.00	0.13
215	600312	平高电气	5,300	103,085.00	0.13
216	000901	航天科技	11,700	102,492.00	0.13
217	688001	华兴源创	4,525	102,174.50	0.13
218	688266	泽璟制药	1,868	101,282.96	0.13
219	002226	江南化工	22,400	100,352.00	0.13
219	300113	顺网科技	9,800	100,352.00	0.13
220	002911	佛燃能源	10,848	99,150.72	0.13
221	002276	万马股份	13,800	98,946.00	0.13
222	000600	建投能源	15,700	98,910.00	0.13
223	600179	安通控股	41,600	96,928.00	0.12
224	002171	楚江新材	14,700	96,873.00	0.12
225	002993	奥海科技	2,600	96,720.00	0.12
226	688106	金宏气体	5,510	96,535.20	0.12
227	000810	创维数字	11,000	94,380.00	0.12
228	600323	瀚蓝环境	4,500	94,050.00	0.12
229	002913	奥士康	3,500	93,835.00	0.12
230	300821	东岳硅材	13,600	93,024.00	0.12
231	605090	九丰能源	3,200	92,800.00	0.12
232	300457	赢合科技	5,200	92,716.00	0.12
233	301262	海看股份	4,100	92,455.00	0.12
234	600750	江中药业	4,000	92,440.00	0.12
235	300451	创业慧康	26,650	92,209.00	0.12
236	002053	云南能投	7,600	91,884.00	0.12
237	600366	宁波韵升	17,600	91,872.00	0.12
238	002204	大连重工	21,500	91,805.00	0.12
239	603118	共进股份	13,700	91,790.00	0.12
240	000875	吉电股份	17,200	91,676.00	0.12
241	600531	豫光金铅	14,200	91,448.00	0.12
242	000657	中钨高新	10,000	91,400.00	0.12
243	603871	嘉友国际	5,160	91,280.40	0.12
244	002585	双星新材	18,400	91,264.00	0.12
245	000088	盐田港	20,100	91,053.00	0.12
246	600477	杭萧钢构	38,900	90,637.00	0.12
247	688018	乐鑫科技	911	89,897.48	0.12
248	002537	海联金汇	17,300	89,441.00	0.11
249	688235	百济神州	769	89,080.96	0.11
250	002221	东华能源	10,800	88,668.00	0.11

251	603693	江苏新能	7,600	88,312.00	0.11
252	600810	神马股份	14,200	88,040.00	0.11
253	688278	特宝生物	1,634	87,500.70	0.11
254	601028	玉龙股份	7,000	87,500.00	0.11
255	688100	威胜信息	2,286	87,210.90	0.11
256	002216	三全食品	7,900	86,742.00	0.11
257	300685	艾德生物	4,900	86,436.00	0.11
258	300031	宝通科技	6,000	86,220.00	0.11
259	688586	江航装备	9,262	86,136.60	0.11
260	688289	圣湘生物	4,885	85,878.30	0.11
261	603638	艾迪精密	6,100	85,583.00	0.11
262	300768	迪普科技	7,200	85,320.00	0.11
263	603071	物产环能	6,800	85,204.00	0.11
264	600718	东软集团	10,300	85,181.00	0.11
265	600604	市北高新	24,600	85,116.00	0.11
266	601949	中国出版	14,400	85,104.00	0.11
267	300226	上海钢联	5,000	84,700.00	0.11
268	301363	美好医疗	2,900	84,100.00	0.11
269	601811	新华文轩	6,000	84,060.00	0.11
270	300151	昌红科技	5,300	83,846.00	0.11
271	001338	永顺泰	8,500	83,300.00	0.11
272	002127	南极电商	31,900	82,940.00	0.11
273	603997	继峰股份	8,100	82,863.00	0.11
274	002265	建设工业	9,600	82,848.00	0.11
275	603983	丸美股份	3,000	82,590.00	0.11
276	603938	三孚股份	7,000	82,250.00	0.11
277	600966	博汇纸业	17,200	82,216.00	0.11
278	300687	赛意信息	5,900	82,128.00	0.11
279	000915	华特达因	2,700	81,432.00	0.10
280	601068	中铝国际	19,300	81,253.00	0.10
281	002961	瑞达期货	7,400	81,030.00	0.10
282	000062	深圳华强	9,100	80,990.00	0.10
283	300811	铂科新材	1,840	80,776.00	0.10
284	688403	汇成股份	9,497	80,534.56	0.10
285	002859	洁美科技	4,000	80,320.00	0.10
286	002901	大博医疗	3,100	80,073.00	0.10
287	300579	数字认证	4,100	79,950.00	0.10
288	600449	宁夏建材	6,800	79,900.00	0.10
289	002583	海能达	19,600	79,772.00	0.10
290	600075	新疆天业	23,100	79,695.00	0.10
291	002233	塔牌集团	10,900	79,679.00	0.10
292	603556	海兴电力	1,700	79,611.00	0.10
293	603565	中谷物流	9,100	79,534.00	0.10

294	600195	中牧股份	10,600	79,394.00	0.10
295	002318	久立特材	3,400	79,322.00	0.10
296	600508	上海能源	5,600	79,240.00	0.10
297	688167	炬光科技	1,439	79,145.00	0.10
298	603609	禾丰股份	12,100	79,134.00	0.10
299	300973	立高食品	2,800	78,652.00	0.10
300	603297	永新光学	1,300	78,637.00	0.10
301	688400	凌云光	4,700	78,396.00	0.10
302	601200	上海环境	9,200	78,200.00	0.10
303	600916	中国黄金	8,100	77,922.00	0.10
304	600252	中恒集团	35,900	77,903.00	0.10
305	002516	旷达科技	21,400	77,896.00	0.10
306	300034	钢研高纳	4,900	77,861.00	0.10
307	601869	长飞光纤	3,200	77,856.00	0.10
308	001213	中铁特货	19,700	77,815.00	0.10
309	603348	文灿股份	2,800	77,532.00	0.10
310	600933	爱柯迪	5,200	76,908.00	0.10
311	603588	高能环境	12,240	76,867.20	0.10
312	300770	新媒股份	2,300	76,774.00	0.10
313	001337	四川黄金	3,300	76,593.00	0.10
314	000848	承德露露	9,700	76,242.00	0.10
315	601969	海南矿业	12,000	76,080.00	0.10
316	603171	税友股份	2,800	75,712.00	0.10
317	000935	四川双马	6,300	75,663.00	0.10
318	600657	信达地产	24,800	75,640.00	0.10
319	300735	光弘科技	3,500	75,600.00	0.10
320	601678	滨化股份	21,600	75,168.00	0.10
321	002036	联创电子	11,100	74,925.00	0.10
322	000869	张裕 A	3,500	74,725.00	0.10
323	000690	宝新能源	14,600	74,460.00	0.10
324	688268	华特气体	1,440	74,318.40	0.10
325	600929	雪天盐业	14,000	74,200.00	0.10
326	003039	顺控发展	5,900	73,927.00	0.09
327	002011	盾安环境	7,500	73,725.00	0.09
327	600776	东方通信	7,500	73,725.00	0.09
328	601886	江河集团	15,100	73,688.00	0.09
329	300762	上海瀚讯	4,100	73,431.00	0.09
330	603888	新华网	3,400	73,134.00	0.09
331	002405	四维图新	11,700	72,774.00	0.09
332	603113	金能科技	13,300	72,751.00	0.09
333	600874	创业环保	13,000	72,670.00	0.09
334	000902	新洋丰	6,100	72,407.00	0.09
335	600210	紫江企业	13,600	72,352.00	0.09

336	002906	华阳集团	2,700	72,252.00	0.09
337	300773	拉卡拉	5,800	72,094.00	0.09
338	600206	有研新材	8,100	72,090.00	0.09
339	000557	西部创业	19,100	71,816.00	0.09
340	000761	本钢板材	28,600	71,786.00	0.09
341	600648	外高桥	8,100	71,766.00	0.09
342	688128	中国电研	4,168	71,731.28	0.09
343	601163	三角轮胎	4,700	71,534.00	0.09
344	002096	易普力	6,000	71,400.00	0.09
345	600864	哈投股份	15,000	71,250.00	0.09
346	002191	劲嘉股份	19,700	71,117.00	0.09
347	600986	浙文互联	16,900	70,980.00	0.09
348	600645	中源协和	4,400	70,840.00	0.09
349	600248	陕建股份	19,500	70,785.00	0.09
350	300726	宏达电子	3,100	70,680.00	0.09
351	301171	易点天下	4,800	70,560.00	0.09
352	300596	利安隆	2,600	70,538.00	0.09
353	600633	浙数文化	8,000	70,480.00	0.09
354	000488	晨鸣纸业	20,300	70,238.00	0.09
355	603699	纽威股份	4,100	70,192.00	0.09
356	600328	中盐化工	10,200	69,972.00	0.09
357	300456	赛微电子	4,400	69,828.00	0.09
358	000969	安泰科技	8,800	69,784.00	0.09
359	300035	中科电气	8,200	69,782.00	0.09
360	601279	英利汽车	18,700	69,751.00	0.09
361	000682	东方电子	6,300	69,552.00	0.09
362	688161	威高骨科	3,508	69,528.56	0.09
363	002043	兔宝宝	6,700	69,479.00	0.09
364	300224	正海磁材	7,500	69,450.00	0.09
365	688800	瑞可达	2,469	69,329.52	0.09
366	301071	力量钻石	2,500	69,275.00	0.09
367	000736	中交地产	7,800	69,264.00	0.09
368	000681	视觉中国	6,000	69,000.00	0.09
369	002777	久远银海	4,600	68,954.00	0.09
370	002705	新宝股份	4,900	68,943.00	0.09
371	600459	贵研铂业	5,100	68,901.00	0.09
372	600577	精达股份	17,300	68,681.00	0.09
373	600335	国机汽车	11,900	68,663.00	0.09
374	300233	金城医药	4,600	68,632.00	0.09
375	688139	海尔生物	1,834	68,224.80	0.09
376	002726	龙大美食	10,400	68,224.00	0.09
377	600601	方正科技	22,700	68,100.00	0.09
378	600055	万东医疗	5,500	67,925.00	0.09

379	688031	星环科技	1,843	67,656.53	0.09
380	002946	新乳业	7,700	67,452.00	0.09
381	000065	北方国际	6,500	67,405.00	0.09
382	600559	老白干酒	3,700	67,266.00	0.09
383	002378	章源钨业	11,700	67,158.00	0.09
384	605589	圣泉集团	3,300	66,957.00	0.09
385	300725	药石科技	2,500	66,925.00	0.09
386	603599	广信股份	5,500	66,715.00	0.09
387	301308	江波龙	700	66,318.00	0.09
388	600869	远东股份	19,000	66,310.00	0.09
389	002041	登海种业	8,200	66,256.00	0.08
390	600496	精工钢构	25,800	66,048.00	0.08
391	600908	无锡银行	12,400	65,968.00	0.08
392	300482	万孚生物	2,700	65,880.00	0.08
393	603915	国茂股份	6,400	65,856.00	0.08
394	605020	永和股份	3,400	65,212.00	0.08
395	603128	华贸物流	11,300	65,201.00	0.08
396	300432	富临精工	10,100	65,044.00	0.08
397	688185	康希诺	1,561	64,141.49	0.08
398	600100	同方股份	12,600	64,134.00	0.08
399	688322	奥比中光	2,397	64,023.87	0.08
400	002706	良信股份	9,300	63,798.00	0.08
401	301293	三博脑科	1,690	63,696.10	0.08
402	603098	森特股份	8,100	63,666.00	0.08
403	603477	巨星农牧	2,200	63,140.00	0.08
404	301327	华宝新能	1,100	63,030.00	0.08
405	301205	联特科技	1,000	62,750.00	0.08
406	600649	城投控股	18,800	62,416.00	0.08
407	300284	苏交科	7,500	60,600.00	0.08
408	301291	明阳电气	2,000	60,100.00	0.08
409	003021	兆威机电	1,300	59,995.00	0.08
410	300953	震裕科技	1,100	59,620.00	0.08
411	601882	海天精工	2,600	59,566.00	0.08
412	688776	国光电气	1,064	58,945.60	0.08
413	002174	游族网络	7,600	57,684.00	0.07
414	688700	东威科技	2,192	57,452.32	0.07
415	688116	天奈科技	2,425	55,969.00	0.07
416	002840	华统股份	3,300	54,747.00	0.07
417	688351	微电生理	2,452	54,042.08	0.07
418	300130	新国都	3,200	53,248.00	0.07
419	603108	润达医疗	3,500	52,990.00	0.07
420	002643	万润股份	5,100	51,000.00	0.07
421	600502	安徽建工	11,800	50,740.00	0.07

422	600641	万业企业	4,100	48,175.00	0.06
423	601619	嘉泽新能	15,200	46,056.00	0.06
424	000090	天健集团	11,100	44,622.00	0.06
425	600120	浙江东方	13,100	43,754.00	0.06
426	601333	广深铁路	13,300	43,092.00	0.06
427	000498	山东路桥	8,000	41,840.00	0.05
428	601777	力帆科技	10,800	41,472.00	0.05
429	002212	天融信	8,300	40,421.00	0.05
430	688261	东微半导	786	40,384.68	0.05
431	301316	慧博云通	2,600	38,168.00	0.05
432	000735	罗牛山	8,800	38,104.00	0.05
433	605365	立达信	2,400	38,088.00	0.05
434	002390	信邦制药	11,400	37,734.00	0.05
435	002839	张家港行	9,200	36,984.00	0.05
436	300123	亚光科技	7,900	36,656.00	0.05
437	300232	洲明科技	6,900	36,018.00	0.05
438	000061	农产品	7,200	34,992.00	0.04
439	002389	航天彩虹	2,500	34,725.00	0.04
440	002091	江苏国泰	5,000	34,050.00	0.04
441	688048	长光华芯	1,072	33,489.28	0.04
442	600073	光明肉业	5,900	32,509.00	0.04
443	688508	芯朋微	890	32,369.30	0.04
444	603103	横店影视	2,300	31,832.00	0.04
445	600587	新华医疗	1,940	30,535.60	0.04
446	002258	利尔化学	3,700	29,674.00	0.04
447	603989	艾华集团	2,100	29,526.00	0.04
448	603043	广州酒家	1,800	28,746.00	0.04
449	003012	东鹏控股	4,700	28,717.00	0.04
450	002060	广东建工	8,200	28,044.00	0.04
451	600586	金晶科技	4,800	27,840.00	0.04
452	600861	北京人力	1,700	27,744.00	0.04
453	600151	航天机电	6,000	27,120.00	0.03
454	600116	三峡水利	3,900	26,910.00	0.03
455	601890	亚星锚链	3,800	26,790.00	0.03
456	000049	德赛电池	1,120	26,264.00	0.03
457	002275	桂林三金	2,100	26,061.00	0.03
458	300332	天壕能源	4,800	25,488.00	0.03
459	002651	利君股份	4,500	24,705.00	0.03
460	300087	荃银高科	3,900	24,102.00	0.03
461	000012	南玻 A	4,700	23,688.00	0.03
461	002182	宝武镁业	2,100	23,688.00	0.03
462	688239	航宇科技	679	23,629.20	0.03
463	002101	广东鸿图	2,100	22,113.00	0.03

464	600635	大众公用	8,200	21,976.00	0.03
465	600480	凌云股份	2,200	21,626.00	0.03
466	300527	中船应急	3,300	21,351.00	0.03
467	601908	京运通	8,400	21,252.00	0.03
468	603730	岱美股份	2,100	20,874.00	0.03
469	000727	冠捷科技	10,100	20,806.00	0.03
470	002539	云图控股	2,900	20,677.00	0.03
471	002746	仙坛股份	3,600	20,628.00	0.03
472	603666	亿嘉和	1,300	20,514.00	0.03
473	600403	大有能源	7,800	20,124.00	0.03
474	603057	紫燕食品	1,300	19,916.00	0.03
475	688327	云从科技	1,739	19,668.09	0.03
476	603368	柳药集团	1,100	19,250.00	0.02
477	300263	隆华科技	3,400	19,040.00	0.02
478	300674	宇信科技	1,700	18,836.00	0.02
479	300406	九强生物	1,200	18,456.00	0.02
480	000503	国新健康	2,700	18,009.00	0.02
481	300303	聚飞光电	3,700	17,982.00	0.02
482	301207	华兰疫苗	1,000	17,670.00	0.02
483	688596	正帆科技	534	17,622.00	0.02
484	001323	慕思股份	600	17,262.00	0.02
485	002434	万里扬	3,500	17,150.00	0.02
486	600963	岳阳林纸	4,600	16,882.00	0.02
487	000813	德展健康	7,700	16,016.00	0.02
488	688076	诺泰生物	200	15,656.00	0.02
489	600780	通宝能源	2,600	15,340.00	0.02
490	300737	科顺股份	3,500	15,050.00	0.02
491	688262	国芯科技	817	14,877.57	0.02
492	688409	富创精密	397	14,665.18	0.02
493	688050	爱博医疗	200	14,664.00	0.02
494	603301	振德医疗	700	14,602.00	0.02
495	600667	太极实业	2,500	14,275.00	0.02
496	000517	荣安地产	5,300	14,204.00	0.02
497	300755	华致酒行	1,000	13,660.00	0.02
498	601606	长城军工	1,400	13,384.00	0.02
499	601718	际华集团	5,300	13,144.00	0.02
500	000767	晋控电力	5,600	13,048.00	0.02
501	002534	西子洁能	1,300	13,013.00	0.02
502	688007	光峰科技	772	12,429.20	0.02
503	301216	万凯新材	1,100	12,309.00	0.02
504	300039	上海凯宝	2,300	12,305.00	0.02
505	603187	海容冷链	1,040	12,126.40	0.02
506	002832	比音勒芬	500	12,085.00	0.02

507	300772	运达股份	1,252	12,019.20	0.02
508	300409	道氏技术	1,400	11,984.00	0.02
509	002847	盐津铺子	280	11,975.60	0.02
510	300327	中颖电子	600	11,808.00	0.02
511	300820	英杰电气	300	11,802.00	0.02
512	002158	汉钟精机	700	11,704.00	0.02
513	001308	康冠科技	500	11,250.00	0.01
514	688298	东方生物	413	11,212.95	0.01
515	600729	重庆百货	500	11,180.00	0.01
516	000990	诚志股份	1,500	11,160.00	0.01
517	000552	甘肃能化	3,200	11,104.00	0.01
518	688097	博众精工	512	10,895.36	0.01
519	300068	南都电源	1,300	10,764.00	0.01
520	002099	海翔药业	2,100	10,731.00	0.01
521	002489	浙江永强	4,400	10,428.00	0.01
522	601528	瑞丰银行	2,200	10,384.00	0.01
523	000837	秦川机床	1,400	10,304.00	0.01
524	000860	顺鑫农业	600	10,044.00	0.01
525	300267	尔康制药	4,700	9,776.00	0.01
526	688389	普门科技	598	9,723.48	0.01
527	688388	嘉元科技	991	9,662.25	0.01
528	002274	华昌化工	1,300	9,646.00	0.01
529	603877	太平鸟	700	9,611.00	0.01
530	002250	联化科技	2,000	9,600.00	0.01
531	601038	一拖股份	600	9,486.00	0.01
532	002349	精华制药	1,400	9,184.00	0.01
533	600675	中华企业	3,700	9,139.00	0.01
534	600123	兰花科创	1,000	8,950.00	0.01
535	688123	聚辰股份	144	8,759.52	0.01
536	600882	妙可蓝多	700	8,729.00	0.01
537	688392	骄成超声	200	8,488.00	0.01
538	600552	凯盛科技	900	8,487.00	0.01
539	600057	厦门象屿	1,200	8,160.00	0.01
540	000581	威孚高科	500	8,140.00	0.01
541	603169	兰石重装	1,800	8,100.00	0.01
542	002990	盛视科技	400	8,052.00	0.01
543	605009	豪悦护理	200	7,888.00	0.01
544	003009	中天火箭	200	7,736.00	0.01
545	301219	腾远钴业	200	7,652.00	0.01
546	300298	三诺生物	300	7,602.00	0.01
547	000597	东北制药	1,900	7,353.00	0.01
548	301239	普瑞眼科	200	7,066.00	0.01
549	300761	立华股份	300	6,792.00	0.01

550	605507	国邦医药	400	6,660.00	0.01
551	688598	金博股份	230	6,509.00	0.01
552	001311	多利科技	260	6,286.80	0.01
553	603055	台华新材	600	6,078.00	0.01
554	688339	亿华通	200	5,996.00	0.01
555	600595	中孚实业	2,400	5,976.00	0.01
556	300140	节能环境	1,000	5,970.00	0.01
557	603170	宝立食品	500	5,940.00	0.01
558	002287	奇正藏药	300	5,874.00	0.01
559	603033	三维股份	500	5,850.00	0.01
560	001322	箭牌家居	800	5,848.00	0.01
561	301217	铜冠铜箔	600	5,760.00	0.01
562	002219	新里程	2,900	5,394.00	0.01
563	688337	普源精电	200	5,044.00	0.01
564	000058	深赛格	900	4,833.00	0.01
565	300352	北信源	1,200	4,608.00	0.01
566	002190	成飞集成	300	4,236.00	0.01
567	600643	爱建集团	1,100	4,147.00	0.01
568	002163	海南发展	700	3,836.00	0.00
569	600305	恒顺醋业	500	3,615.00	0.00
570	000019	深粮控股	600	3,444.00	0.00
571	002283	天润工业	300	1,287.00	0.00
572	688696	极米科技	4	308.96	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	601567	三星医疗	4,800	168,000.00	0.22
2	002979	雷赛智能	8,200	149,240.00	0.19
3	002677	浙江美大	17,800	144,358.00	0.19
4	000921	海信家电	4,391	141,565.84	0.18
5	002838	道恩股份	14,400	130,464.00	0.17
6	002128	电投能源	5,700	120,270.00	0.15
7	300408	三环集团	4,000	116,760.00	0.15
8	688010	福光股份	7,209	112,244.13	0.14
9	301195	北路智控	3,600	107,064.00	0.14
10	000698	沈阳化工	35,100	106,704.00	0.14
11	688111	金山办公	469	106,697.50	0.14
12	688496	清越科技	11,360	104,966.40	0.13
13	300132	青松股份	30,100	104,748.00	0.13
14	300181	佐力药业	6,800	102,816.00	0.13
15	600483	福能股份	8,520	99,343.20	0.13
16	300401	花园生物	6,800	97,512.00	0.13
17	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.12

18	300054	鼎龙股份	3,900	88,452.00	0.11
19	603979	金诚信	1,700	85,901.00	0.11
20	603010	万盛股份	9,300	83,793.00	0.11
21	601399	国机重装	31,800	82,044.00	0.11
22	601965	中国汽研	4,600	77,694.00	0.10
23	600612	老凤祥	1,300	75,647.00	0.10
24	002741	光华科技	8,300	74,534.00	0.10
25	000032	深桑达 A	4,900	73,402.00	0.09
26	002768	国恩股份	3,900	72,930.00	0.09
27	600098	广州发展	11,100	71,040.00	0.09
28	002556	辉隆股份	16,700	69,639.00	0.09
29	603298	杭叉集团	3,540	69,525.60	0.09
30	300002	神州泰岳	8,500	69,020.00	0.09
31	601019	山东出版	5,800	68,556.00	0.09
32	688213	思特威	1,373	66,590.50	0.09
33	300803	指南针	1,800	65,538.00	0.08
34	000789	万年青	14,400	65,376.00	0.08
35	002436	兴森科技	6,200	63,984.00	0.08
36	300567	精测电子	1,100	62,161.00	0.08
37	002307	北新路桥	21,700	61,845.00	0.08
38	600872	中炬高新	2,700	61,263.00	0.08
39	300765	新诺威	2,280	57,524.40	0.07
40	600661	昂立教育	5,100	57,273.00	0.07
41	301165	锐捷网络	1,800	53,712.00	0.07
42	300662	科锐国际	2,900	46,777.00	0.06
43	605500	森林包装	4,400	27,060.00	0.03
44	601077	渝农商行	5,000	25,100.00	0.03
45	601318	中国平安	500	20,680.00	0.03
46	601018	宁波港	5,400	18,360.00	0.02
47	601668	中国建筑	2,900	15,399.00	0.02
48	688371	菲沃泰	1,476	14,819.04	0.02
49	688349	三一重能	552	13,711.68	0.02
50	600284	浦东建设	2,500	13,350.00	0.02
51	600018	上港集团	2,200	12,716.00	0.02
52	603568	伟明环保	600	12,348.00	0.02
53	002645	华宏科技	1,900	12,084.00	0.02
54	605369	拱东医疗	300	11,970.00	0.02
55	600673	东阳光	1,700	11,968.00	0.02
56	300383	光环新网	1,400	11,830.00	0.02
56	603096	新经典	700	11,830.00	0.02
57	600011	华能国际	1,200	11,544.00	0.01
58	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.01
59	688008	澜起科技	200	11,432.00	0.01

60	000063	中兴通讯	400	11,188.00	0.01
61	603195	公牛集团	145	11,182.40	0.01
62	603605	珀莱雅	100	11,099.00	0.01
63	300639	凯普生物	2,400	11,040.00	0.01
64	601398	工商银行	1,900	10,830.00	0.01
65	300502	新易盛	100	10,555.00	0.01
66	600183	生益科技	500	10,530.00	0.01
67	002008	大族激光	500	10,400.00	0.01
68	301267	华夏眼科	500	10,360.00	0.01
69	603032	德新科技	900	10,287.00	0.01
70	688718	唯赛勃	1,175	10,046.25	0.01
71	600704	物产中大	2,300	9,982.00	0.01
72	600642	申能股份	1,100	9,713.00	0.01
73	002420	毅昌科技	2,100	9,576.00	0.01
74	600499	科达制造	1,100	9,273.00	0.01
75	603369	今世缘	200	9,240.00	0.01
76	000589	贵州轮胎	1,800	9,126.00	0.01
77	688133	泰坦科技	564	8,899.92	0.01
78	688733	壹石通	595	8,895.25	0.01
79	601717	郑煤机	600	8,880.00	0.01
80	600707	彩虹股份	1,300	8,853.00	0.01
81	002519	银河电子	1,800	8,838.00	0.01
82	600332	白云山	300	8,799.00	0.01
83	601898	中煤能源	700	8,736.00	0.01
84	600967	内蒙一机	1,200	8,640.00	0.01
85	600876	凯盛新能	900	8,496.00	0.01
86	002273	水晶光电	500	8,490.00	0.01
87	300767	震安科技	1,000	8,480.00	0.01
88	600372	中航机载	700	8,379.00	0.01
89	601601	中国太保	300	8,358.00	0.01
90	300999	金龙鱼	300	8,205.00	0.01
91	300396	迪瑞医疗	400	8,124.00	0.01
92	300790	宇瞳光学	600	8,100.00	0.01
93	600770	综艺股份	3,500	8,015.00	0.01
94	603558	健盛集团	800	7,960.00	0.01
95	001202	炬申股份	700	7,931.00	0.01
96	600096	云天化	400	7,768.00	0.01
97	300842	帝科股份	200	7,760.00	0.01
98	002573	清新环境	2,000	7,740.00	0.01
98	600066	宇通客车	300	7,740.00	0.01
99	600737	中粮糖业	800	7,672.00	0.01
100	688253	英诺特	200	7,622.00	0.01
101	601512	中新集团	1,000	7,620.00	0.01

102	002536	飞龙股份	800	7,616.00	0.01
103	605007	五洲特纸	600	7,578.00	0.01
104	300550	和仁科技	800	7,560.00	0.01
105	002463	沪电股份	200	7,300.00	0.01
106	003000	劲仔食品	600	7,230.00	0.01
107	002984	森麒麟	300	7,227.00	0.01
108	605305	中际联合	280	7,221.20	0.01
109	600315	上海家化	400	7,112.00	0.01
110	002153	石基信息	1,200	6,876.00	0.01
111	688225	亚信安全	600	6,798.00	0.01
112	600985	淮北矿业	400	6,696.00	0.01
113	300673	佩蒂股份	500	6,560.00	0.01
114	300791	仙乐健康	260	6,552.00	0.01
115	000975	山金国际	400	6,516.00	0.01
116	002852	道道全	900	6,480.00	0.01
117	603786	科博达	100	6,415.00	0.01
118	603681	永冠新材	500	6,375.00	0.01
119	600377	宁沪高速	500	6,300.00	0.01
120	603277	银都股份	200	6,008.00	0.01
121	002755	奥赛康	600	5,790.00	0.01
122	001872	招商港口	300	5,775.00	0.01
123	600955	维远股份	400	5,764.00	0.01
124	600177	雅戈尔	800	5,696.00	0.01
125	605099	共创草坪	300	5,673.00	0.01
126	601566	九牧王	600	5,052.00	0.01
127	603235	天新药业	200	4,806.00	0.01

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	600098	广州发展	1,737,787.00	2.05
2	688381	帝奥微	1,656,326.11	1.95
3	601019	山东出版	1,654,233.00	1.95
4	688232	新点软件	1,641,634.15	1.94
5	600012	皖通高速	1,567,550.98	1.85
6	688127	蓝特光学	1,556,451.49	1.84
7	600685	中船防务	1,494,098.00	1.76
8	603766	隆鑫通用	1,472,860.00	1.74
9	603556	海兴电力	1,469,775.00	1.73
10	600273	嘉化能源	1,443,627.00	1.70
11	603699	纽威股份	1,408,119.00	1.66
12	600285	羚锐制药	1,391,457.00	1.64

13	688238	和元生物	1,389,886.26	1.64
14	601801	皖新传媒	1,385,461.00	1.63
15	601326	秦港股份	1,375,867.00	1.62
16	002545	东方铁塔	1,358,211.00	1.60
17	601369	陕鼓动力	1,297,637.00	1.53
18	603171	税友股份	1,280,732.00	1.51
19	600688	上海石化	1,278,281.00	1.51
20	600649	城投控股	1,270,940.00	1.50

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	601019	山东出版	2,037,105.00	2.40
2	600098	广州发展	1,923,295.00	2.27
3	603766	隆鑫通用	1,876,602.00	2.21
4	600012	皖通高速	1,678,741.00	1.98
5	002130	沃尔核材	1,674,237.00	1.98
6	601801	皖新传媒	1,619,299.00	1.91
7	688381	帝奥微	1,597,274.04	1.88
8	600502	安徽建工	1,589,846.00	1.88
9	603556	海兴电力	1,580,799.00	1.87
10	603171	税友股份	1,519,654.00	1.79
11	600685	中船防务	1,506,398.00	1.78
12	688127	蓝特光学	1,493,486.02	1.76
13	600037	歌华有线	1,434,689.00	1.69
14	600872	中炬高新	1,428,158.00	1.69
15	603989	艾华集团	1,416,936.00	1.67
16	601369	陕鼓动力	1,388,471.00	1.64
17	002645	华宏科技	1,383,543.00	1.63
18	688232	新点软件	1,375,571.81	1.62
19	603699	纽威股份	1,372,981.00	1.62
20	600688	上海石化	1,345,732.00	1.59

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	391,557,934.80
卖出股票收入（成交）总额	395,205,637.02

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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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	609,082.15
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	609,082.15

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 (%)
927	100,220.16	55,383,270.00	59.61	37,520,821.00	40.39

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	建信人寿保险股份有限公司-传统保险产品	13,153,600.00	14.16
2	招商证券股份有限公司	8,702,406.00	9.37
3	张辉	8,267,900.00	8.90
4	国泰君安证券股份有限公司	7,008,700.00	7.54
5	方正证券股份有限公司	6,119,898.00	6.59
6	国信证券股份有限公司	4,951,241.00	5.33
7	广发证券股份有限公司	3,051,947.00	3.29

8	东方证券股份有限公司	2,928,500.00	3.15
9	中信建投证券股份有限公司	2,590,671.00	2.79
10	中信证券股份有限公司	2,313,918.00	2.49

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（2022 年 11 月 24 日） 基金份额总额	1,250,904,091.00
本报告期期初基金份额总额	86,904,091.00
本报告期基金总申购份额	159,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	153,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	92,904,091.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
招商证券	2	339,243,658.97	43.12	117,346.65	43.19	-
申万宏源	1	325,883,882.08	41.42	112,727.80	41.49	-
西南证券	4	121,636,030.77	15.46	41,618.45	15.32	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东北证券	5	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-

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。

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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证	-	-	-	-	-	-

券						
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
红塔证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证	-	-	-	-	-	-

券						
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
中原证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源西部	-	-	-	-	-	-

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

3	《银华中证 1000 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
4	《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 1 月 25 日
5	《银华中证 1000 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 1 月 25 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 1 月 25 日
7	《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
8	《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
9	《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
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 3 月 19 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 29 日
12	《银华中证 1000 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
13	《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
14	《关于银华中证 1000 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, 上海证券报	2024 年 4 月 15 日
15	《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
16	《银华中证 1000 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	《关于银华中证 1000 增强策略交易	本基金管理人网站, 中	2024 年 4 月 26 日

	型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	
18	《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
19	《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
20	《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
21	《银华中证 1000 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 20 日
22	《关于银华中证 1000 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, 上海证券报	2024 年 6 月 24 日
23	《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
24	《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

§ 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	20240129-20240201	0.00	53,853,400.00	40,699,800.00	13,153,600.00	14.16
产品特有风险							
<p>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:</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>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;</p>							

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

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 1000 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 1000 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 1000 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 1000 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。

2024 年 8 月 31 日