

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证
券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪港深
场内简称	沪港深（扩位证券简称：沪港深 500ETF）
基金主代码	517000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	557,793,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。</p> <p>建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	银华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张姗
	联系电话	(010)58163000	400-61-95555
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	400-61-95555	
传真	(010)58163027	0755-83195201	
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	100738	518040	
法定代表人	王珠林	缪建民	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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	-20,075,749.19
本期利润	15,219,838.22
加权平均基金份额本期利润	0.0259
本期加权平均净值利润率	3.80%
本期基金份额净值增长率	3.71%
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	-168,318,700.77
期末可供分配基金份额利润	-0.3018
期末基金资产净值	389,474,299.23
期末基金份额净值	0.6982
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	-30.18%

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。

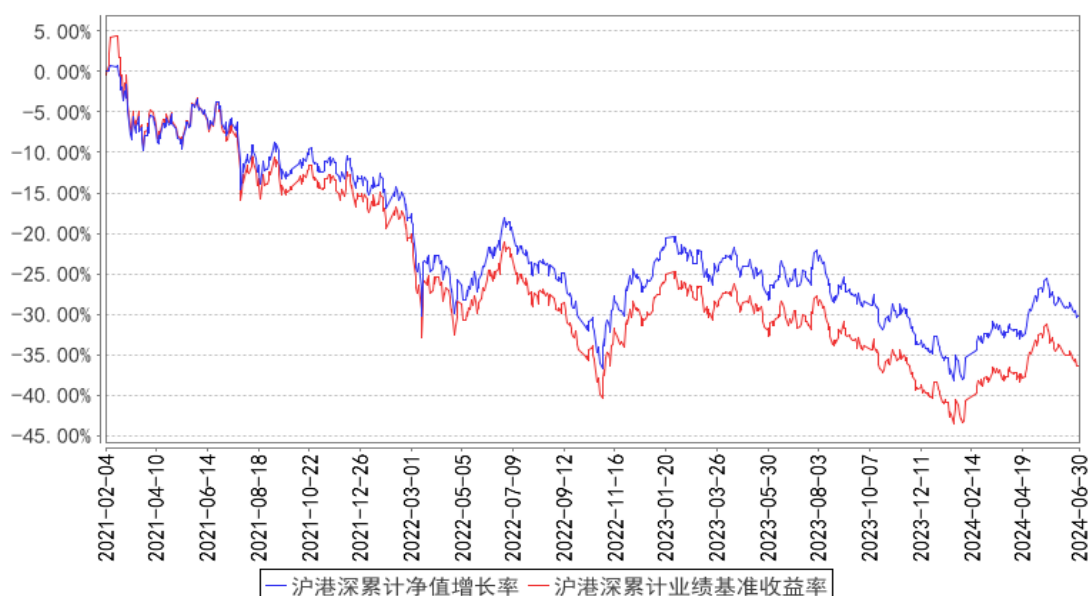
3.2 基金净值表现

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	-1.80%	0.53%	-2.60%	0.55%	0.80%	-0.02%
过去三个月	3.12%	0.79%	2.13%	0.82%	0.99%	-0.03%
过去六个月	3.71%	0.93%	3.37%	0.97%	0.34%	-0.04%
过去一年	-6.09%	0.92%	-8.18%	0.94%	2.09%	-0.02%
过去三年	-27.01%	1.09%	-33.12%	1.12%	6.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-30.18%	1.09%	-36.30%	1.13%	6.12%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

沪港深累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，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：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包

括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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		
王帅先生	本基金的基金经理	2021年2月4日	-	11.5年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018年8月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2019年6月28日至2021年2月25日担任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年11月1日至2021年5月19日兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年12月6日至2021年2月25日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年1月22日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年3月20日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年5月28日至2023年4月12日兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2020年12月10日至2022年6月20日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年1月5日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月3日至2022年6月20日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年2月4日起兼任银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月9日至2022年6月20日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月3日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月10日至2022年6月20日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年4月29日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年

					<p>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 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。</p>
李宜璇女士	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	10 年	<p>博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014 年 12 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资</p>

				<p>基金（LOF）基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 17 日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 7 日起兼任银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2024</p>
--	--	--	--	--

					年 6 月 13 日起兼任银华恒指港股通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。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2021 年 4 月 19 日	-	10 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金,历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员,现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 股和港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 0.6982 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.71%，业绩比较基准收益率为 3.37%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华中证沪港深 500 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	19,488,189.14	23,230,373.19
结算备付金		1,550,303.46	4,883.86
存出保证金		11,625.33	7,296.65
交易性金融资产	6.4.7.2	369,602,663.95	393,059,339.32
其中：股票投资		369,602,663.95	393,059,339.32
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		2,638,710.06	-
应收股利		814,509.71	22,969.54
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		394,106,001.65	416,324,862.56
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		4,312,610.48	33.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		162,671.63	174,243.82
应付托管费		32,534.33	34,848.76
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	123,885.98	225,160.60
负债合计		4,631,702.42	434,287.02
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	557,793,000.00	617,793,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-168,318,700.77	-201,902,424.46
净资产合计		389,474,299.23	415,890,575.54
负债和净资产总计		394,106,001.65	416,324,862.56

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6982 元，基金份额总额 557,793,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		16,527,172.10	4,139,708.43
1. 利息收入		34,207.08	50,774.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	34,207.08	50,774.53
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）		-18,674,479.00	-15,260,860.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,010,126.74	-21,157,948.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	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	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,335,647.74	5,897,088.36
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	35,295,587.41	19,266,352.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	-128,143.39	83,442.39

号填列)			
减：二、营业总支出		1,307,333.88	1,643,881.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	996,667.35	1,271,495.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	199,333.58	254,299.05
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	111,332.95	118,086.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,219,838.22	2,495,827.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,219,838.22	2,495,827.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,219,838.22	2,495,827.38

6.3 净资产变动表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	617,793,000.00	-	-201,902,424.46	415,890,575.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	617,793,000.00	-	-201,902,424.46	415,890,575.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-60,000,000.00	-	33,583,723.69	-26,416,276.31

(一)、综合收益总额	-	-	15,219,838.22	15,219,838.22
(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)	-60,000,000.00	-	18,363,885.47	-41,636,114.53
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	-2,884,641.87	7,115,358.13
2. 基金赎回款	-70,000,000.00	-	21,248,527.34	-48,751,472.66
(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	557,793,000.00	-	-168,318,700.77	389,474,299.23
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	697,793,000.00	-	-180,413,852.17	517,379,147.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	697,793,000.00	-	-180,413,852.17	517,379,147.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-40,000,000.00	-	11,708,966.68	-28,291,033.32
(一)、综合收益总额	-	-	2,495,827.38	2,495,827.38
(二)、本期基金份额交易产生的	-40,000,000.00	-	9,213,139.30	-30,786,860.70

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	15,000,000.00	-	-3,444,619.32	11,555,380.68
2. 基金赎 回款	-55,000,000.00	-	12,657,758.62	-42,342,241.38
(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	657,793,000.00	-	-168,704,885.4 9	489,088,114.51

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

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3526 号《关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,482,793,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0165 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,482,793,000.00 份基金份额,未发生利息折份额的情况。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管通知书[2021]76号核准,本基金1,482,793,000.00份基金份额于2021年3月5日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、港股通标的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为:中证沪港深500指数收益率。

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

本基金本报告期末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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得

的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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	19,488,189.14
等于：本金	19,486,338.03
加：应计利息	1,851.11
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	19,488,189.14

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	505,910,911.46	-	369,602,663.95	-136,308,247.51
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	505,910,911.46	-	369,602,663.95	-136,308,247.51

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,459.84
其中：交易所市场	19,459.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
合计	123,885.98

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	617,793,000.00	617,793,000.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-70,000,000.00	-70,000,000.00
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	557,793,000.00	557,793,000.00

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	-102,700,129.54	-99,202,294.92	-201,902,424.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-102,700,129.54	-99,202,294.92	-201,902,424.46
本期利润	-20,075,749.19	35,295,587.41	15,219,838.22
本期基金份额交易产生的变动数	10,797,254.13	7,566,631.34	18,363,885.47
其中：基金申购款	-1,951,100.09	-933,541.78	-2,884,641.87
基金赎回款	12,748,354.22	8,500,173.12	21,248,527.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-111,978,624.60	-56,340,076.17	-168,318,700.77

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	32,537.43
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	1,621.48
其他	48.17
合计	34,207.08

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	-19,949,979.27
股票投资收益——赎回差价收入	-4,060,147.47

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	-24,010,126.74

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	44,661,062.47
减：卖出股票成本总额	64,532,026.97
减：交易费用	79,014.77
买卖股票差价收入	-19,949,979.27

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	48,751,472.66
减：现金支付赎回款总额	30,760,845.66
减：赎回股票成本总额	22,050,774.47
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,060,147.47

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	5,335,647.74
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	5,335,647.74

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	35,295,587.41
股票投资	35,295,587.41
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	35,295,587.41

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	-128,143.39
合计	-128,143.39

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	821.74
其他	6,085.07
合计	111,332.95

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	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管理费	996,667.35	1,271,495.70

其中：应支付销售机构的客户维护费	15,566.09	14,501.56
应支付基金管理人的净管理费	981,101.26	1,256,994.14

注：支付基金管理人银华基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	199,333.58	254,299.05

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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
招商银行	19,488,189.14	32,537.43	24,211,042.02	47,985.90

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）发行的股票：招商银行（代码 600036）142,900.00 股，期末公允价值为人民币 4,885,751.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.25%；招商银行（代码 3968）53,000.00 股，期末公允价值为人民币 1,714,788.82 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.44%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：中国交建（代码 601800）41,200.00 股，期末公允价值为人民币 368,328.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.09%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：上汽集团（600104）53,300.00 股，期末公允价值为人民币 738,738.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.19%。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

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	19,488,189.14	-	-	-	19,488,189.14
结算备付金	1,550,303.46	-	-	-	1,550,303.46
存出保证金	11,625.33	-	-	-	11,625.33
交易性金融资产	-	-	-	-369,602,663.95	369,602,663.95
应收股利	-	-	-	814,509.71	814,509.71
应收清算款	-	-	-	2,638,710.06	2,638,710.06
资产总计	21,050,117.93	-	-	-373,055,883.72	394,106,001.65
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	162,671.63	162,671.63
应付托管费	-	-	-	32,534.33	32,534.33
应付清算款	-	-	-	4,312,610.48	4,312,610.48
其他负债	-	-	-	123,885.98	123,885.98
负债总计	-	-	-	4,631,702.42	4,631,702.42
利率敏感度缺口	21,050,117.93	-	-	-368,424,181.30	389,474,299.23
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	23,230,373.19	-	-	-	23,230,373.19
结算备付金	4,883.86	-	-	-	4,883.86

存出保证金	7,296.65	-	-	-	7,296.65
交易性金融资产	-	-	-	-393,059,339.32	393,059,339.32
应收股利	-	-	-	22,969.54	22,969.54
资产总计	23,242,553.70	-	-	-393,082,308.86	416,324,862.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	174,243.82	174,243.82
应付托管费	-	-	-	34,848.76	34,848.76
应付清算款	-	-	-	33.84	33.84
其他负债	-	-	-	225,160.60	225,160.60
负债总计	-	-	-	434,287.02	434,287.02
利率敏感度缺口	23,242,553.70	-	-	-392,648,021.84	415,890,575.54

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	147,125,721.33	-	147,125,721.33
资产合计	-	147,125,721.33	-	147,125,721.33
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	147,125,721.33	-	147,125,721.33

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

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变。		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币-5%	-7,356,286.07	-7,694,796.01
	港币 5%	7,356,286.07	7,694,796.01

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	369,602,663.95	94.90	393,059,339.32	94.51
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	369,602,663.95	94.90	393,059,339.32	94.51

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%	18,812,436.62	20,359,597.86
	业绩比较基准下降 5%	-18,812,436.62	-20,359,597.86

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	369,538,252.08	392,579,565.11
第二层次	24,002.55	-
第三层次	40,409.32	479,774.21
合计	369,602,663.95	393,059,339.32

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	369,602,663.95	93.78
	其中：股票	369,602,663.95	93.78
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	21,038,492.60	5.34
8	其他各项资产	3,464,845.10	0.88
9	合计	394,106,001.65	100.00

注：1、股票投资含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 147,125,721.33 元，占期末净值比例为 37.78%。

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	2,592,330.00	0.67
B	采矿业	13,155,454.50	3.38
C	制造业	119,926,555.97	30.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,616,158.00	2.47
E	建筑业	4,646,395.40	1.19
F	批发和零售业	743,541.05	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	7,946,520.30	2.04
H	住宿和餐饮业	121,794.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,851,750.89	2.53
J	金融业	47,615,210.58	12.23
K	房地产业	1,996,428.00	0.51
L	租赁和商务服务业	1,642,168.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	1,632,007.90	0.42
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	641,480.96	0.16
R	文化、体育和娱乐业	144,540.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	222,272,335.55	57.07

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	-	-
C	制造业	204,607.07	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	204,607.07	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,332,521.92	0.34
消费者非必需品	18,994,793.79	4.88
消费者常用品	4,804,806.13	1.23

能源	8,943,820.44	2.30
金融	50,008,760.02	12.84
医疗保健	3,571,349.70	0.92
工业	6,968,027.96	1.79
信息技术	6,824,373.03	1.75
电信服务	34,311,817.62	8.81
公用事业	5,108,856.82	1.31
地产建筑业	6,256,593.90	1.61
合计	147,125,721.33	37.78

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	00700	腾讯控股	76,000	25,831,034.43	6.63
2	00005	汇丰控股	216,000	13,464,585.50	3.46
3	600519	贵州茅台	7,300	10,711,947.00	2.75
4	601318	中国平安	124,170	5,135,671.20	1.32
4	02318	中国平安	86,000	2,778,562.99	0.71
5	00939	建设银行	1,388,000	7,309,435.08	1.88
5	601939	建设银行	77,600	574,240.00	0.15
6	03690	美团-W	72,020	7,302,737.83	1.88
7	600036	招商银行	142,900	4,885,751.00	1.25
7	03968	招商银行	53,000	1,714,788.82	0.44
8	01398	工商银行	1,002,000	4,243,304.87	1.09
8	601398	工商银行	404,500	2,305,650.00	0.59
9	01299	友邦保险	129,400	6,259,341.98	1.61
10	00941	中国移动	71,000	4,989,621.56	1.28
10	600941	中国移动	10,400	1,118,000.00	0.29
11	300750	宁德时代	30,491	5,489,294.73	1.41
12	01211	比亚迪股份	12,500	2,646,772.00	0.68
12	002594	比亚迪	10,400	2,602,600.00	0.67
13	00883	中国海洋石油	206,000	4,211,470.59	1.08
13	600938	中国海油	24,100	795,300.00	0.20
14	03988	中国银行	966,000	3,394,348.19	0.87
14	601988	中国银行	242,900	1,122,198.00	0.29
15	601899	紫金矿业	190,100	3,340,057.00	0.86
15	02899	紫金矿业	66,000	992,703.78	0.25
16	600900	长江电力	141,100	4,080,612.00	1.05
17	000333	美的集团	56,300	3,631,350.00	0.93
18	601328	交通银行	316,800	2,366,496.00	0.61
18	03328	交通银行	202,000	1,130,135.14	0.29

19	00388	香港交易所	14,600	3,333,947.03	0.86
20	00857	中国石油股份	244,000	1,759,281.97	0.45
20	601857	中国石油	130,800	1,349,856.00	0.35
21	01810	小米集团-W	202,000	3,038,275.21	0.78
22	601088	中国神华	38,100	1,690,497.00	0.43
22	01088	中国神华	39,000	1,279,622.99	0.33
23	601166	兴业银行	167,800	2,956,636.00	0.76
24	000858	五粮液	22,432	2,872,193.28	0.74
25	601288	农业银行	368,100	1,604,916.00	0.41
25	01288	农业银行	355,000	1,082,164.68	0.28
26	00386	中国石油化工股份	282,000	1,302,321.35	0.33
26	600028	中国石化	168,800	1,066,816.00	0.27
27	600030	中信证券	112,610	2,052,880.30	0.53
27	06030	中信证券	24,000	251,899.68	0.06
28	002475	立讯精密	57,900	2,276,049.00	0.58
29	000651	格力电器	52,000	2,039,440.00	0.52
30	300760	迈瑞医疗	7,000	2,036,370.00	0.52
31	600690	海尔智家	43,600	1,237,368.00	0.32
31	06690	海尔智家	33,000	786,091.28	0.20
32	600276	恒瑞医药	51,540	1,982,228.40	0.51
33	688981	中芯国际	22,803	1,051,218.30	0.27
33	00981	中芯国际	55,500	867,192.03	0.22
34	600887	伊利股份	73,400	1,896,656.00	0.49
35	601728	中国电信	179,300	1,102,695.00	0.28
35	00728	中国电信	160,000	676,113.34	0.17
36	600309	万华化学	21,700	1,754,662.00	0.45
37	000725	京东方 A	426,700	1,745,203.00	0.45
38	00669	创科实业	21,000	1,709,632.18	0.44
39	601601	中国太保	39,500	1,100,470.00	0.28
39	02601	中国太保	32,200	560,140.92	0.14
40	09633	农夫山泉	46,600	1,575,769.40	0.40
41	300059	东方财富	145,699	1,538,581.44	0.40
42	601816	京沪高铁	283,600	1,522,932.00	0.39
43	01024	快手-W	35,000	1,474,206.37	0.38
44	02628	中国人寿	86,000	866,534.90	0.22
44	601628	中国人寿	19,200	596,160.00	0.15
45	300308	中际旭创	10,300	1,420,164.00	0.36
46	002714	牧原股份	31,500	1,373,400.00	0.35
47	00002	中电控股	23,500	1,353,367.54	0.35
48	002415	海康威视	43,100	1,332,221.00	0.34
49	601668	中国建筑	240,300	1,275,993.00	0.33
50	600919	江苏银行	169,300	1,257,899.00	0.32
51	601138	工业富联	45,900	1,257,660.00	0.32

52	00016	新鸿基地产	20,000	1,233,030.68	0.32
53	000568	泸州老窖	8,500	1,219,665.00	0.31
54	300498	温氏股份	61,500	1,218,930.00	0.31
55	600809	山西汾酒	5,560	1,172,492.80	0.30
56	601985	中国核电	109,000	1,161,940.00	0.30
57	600406	国电南瑞	46,275	1,155,024.00	0.30
58	601225	陕西煤业	44,700	1,151,919.00	0.30
59	002371	北方华创	3,600	1,151,604.00	0.30
60	603259	药明康德	29,160	1,142,780.40	0.29
61	601919	中远海控	73,570	1,139,599.30	0.29
62	000001	平安银行	111,900	1,135,785.00	0.29
63	06160	百济神州	14,400	1,132,891.43	0.29
64	601658	邮储银行	128,000	648,960.00	0.17
64	01658	邮储银行	115,000	480,708.56	0.12
65	600031	三一重工	68,400	1,128,600.00	0.29
66	02020	安踏体育	16,400	1,122,596.40	0.29
67	600000	浦发银行	135,500	1,115,165.00	0.29
68	300124	汇川技术	21,650	1,110,645.00	0.29
69	02015	理想汽车-W	17,100	1,097,160.01	0.28
70	000792	盐湖股份	62,800	1,095,860.00	0.28
71	02388	中银香港	49,000	1,075,547.75	0.28
72	00001	长和	31,000	1,058,161.19	0.27
73	601766	中国中车	140,500	1,055,155.00	0.27
74	600150	中国船舶	25,700	1,046,247.00	0.27
75	300274	阳光电源	16,840	1,044,585.20	0.27
76	600050	中国联通	220,600	1,036,820.00	0.27
77	000063	中兴通讯	36,700	1,026,499.00	0.26
78	000338	潍柴动力	62,500	1,015,000.00	0.26
79	002352	顺丰控股	28,200	1,006,458.00	0.26
80	601169	北京银行	170,900	998,056.00	0.26
81	00027	银河娱乐	30,000	996,646.56	0.26
82	01109	华润置地	41,000	993,497.81	0.26
83	09987	百胜中国	4,500	991,444.28	0.25
84	601012	隆基绿能	70,060	982,241.20	0.25
85	603501	韦尔股份	9,770	970,844.90	0.25
86	600837	海通证券	111,200	951,872.00	0.24
87	000100	TCL 科技	216,780	936,489.60	0.24
88	600016	民生银行	245,600	930,824.00	0.24
89	002230	科大讯飞	21,400	919,130.00	0.24
90	600660	福耀玻璃	18,500	886,150.00	0.23
91	300502	新易盛	8,200	865,510.00	0.22
92	02057	中通快递-W	5,650	846,720.62	0.22
93	00992	联想集团	84,000	844,849.62	0.22

94	002142	宁波银行	38,190	842,471.40	0.22
95	601229	上海银行	114,884	834,057.84	0.21
96	600089	特变电工	58,460	810,840.20	0.21
97	00011	恒生银行	8,800	806,371.03	0.21
98	00998	中信银行	120,000	548,703.22	0.14
98	601998	中信银行	35,600	238,520.00	0.06
99	601390	中国中铁	118,300	771,316.00	0.20
100	000625	长安汽车	57,184	767,981.12	0.20
101	01171	兖矿能源	38,400	391,123.54	0.10
101	600188	兖矿能源	15,950	362,543.50	0.09
102	688041	海光信息	10,657	749,400.24	0.19
103	600104	上汽集团	53,300	738,738.00	0.19
104	603986	兆易创新	7,680	734,361.60	0.19
105	601688	华泰证券	59,100	732,249.00	0.19
106	600048	保利发展	82,900	726,204.00	0.19
107	02313	申洲国际	10,400	725,653.61	0.19
108	601006	大秦铁路	100,600	720,296.00	0.18
109	600905	三峡能源	165,100	719,836.00	0.18
110	688012	中微公司	5,064	715,340.64	0.18
111	02328	中国财险	80,000	708,239.68	0.18
112	002027	分众传媒	116,800	707,808.00	0.18
113	601211	国泰君安	52,100	705,955.00	0.18
114	00003	香港中华煤气	129,950	704,500.43	0.18
115	600436	片仔癀	3,400	704,378.00	0.18
116	603019	中科曙光	16,900	701,350.00	0.18
117	601888	中国中免	11,200	699,888.00	0.18
118	601600	中国铝业	91,500	698,145.00	0.18
119	603993	洛阳钼业	81,500	692,750.00	0.18
120	601818	光大银行	214,700	680,599.00	0.17
121	00168	青岛啤酒股份	8,000	380,405.02	0.10
121	600600	青岛啤酒	4,100	298,357.00	0.08
122	600019	宝钢股份	101,900	677,635.00	0.17
123	603288	海天味业	19,261	663,926.67	0.17
124	01519	极兔速递-W	101,800	662,454.18	0.17
125	600585	海螺水泥	27,800	655,802.00	0.17
126	00006	电能实业	17,000	655,532.41	0.17
127	00267	中信股份	101,000	654,482.83	0.17
128	01113	长实集团	24,500	654,049.31	0.17
129	601989	中国重工	131,800	649,774.00	0.17
130	600886	国投电力	34,300	625,632.00	0.16
131	00688	中国海外发展	50,500	624,063.20	0.16
132	01801	信达生物	18,500	621,352.54	0.16
133	601009	南京银行	59,700	620,283.00	0.16

134	688111	金山办公	2,722	619,255.00	0.16
135	600795	国电电力	102,700	615,173.00	0.16
136	688008	澜起科技	10,436	596,521.76	0.15
137	600438	通威股份	31,200	596,232.00	0.15
138	600999	招商证券	42,800	595,348.00	0.15
139	000938	紫光股份	26,500	592,275.00	0.15
140	000425	徐工机械	81,600	583,440.00	0.15
141	600547	山东黄金	20,900	572,242.00	0.15
142	002304	洋河股份	7,000	565,180.00	0.15
143	300014	亿纬锂能	14,100	562,872.00	0.14
144	002463	沪电股份	15,400	562,100.00	0.14
145	00175	吉利汽车	70,000	561,572.00	0.14
146	600893	航发动力	15,300	559,215.00	0.14
147	002179	中航光电	14,622	556,367.10	0.14
148	601669	中国电建	99,500	556,205.00	0.14
149	300015	爱尔眼科	53,728	554,472.96	0.14
150	01093	石药集团	96,000	544,979.48	0.14
151	000002	万 科 A	78,400	543,312.00	0.14
152	002241	歌尔股份	27,500	536,525.00	0.14
153	02688	新奥能源	9,100	534,451.72	0.14
154	600926	杭州银行	40,900	533,745.00	0.14
155	000538	云南白药	10,320	527,868.00	0.14
156	600584	长电科技	16,500	523,215.00	0.13
157	600760	中航沈飞	12,641	506,904.10	0.13
158	02269	药明生物	48,000	505,551.71	0.13
159	600111	北方稀土	29,300	503,960.00	0.13
160	600522	中天科技	31,400	497,690.00	0.13
161	00788	中国铁塔	538,000	495,932.06	0.13
162	600489	中金黄金	33,500	495,800.00	0.13
163	002050	三花智控	25,900	494,172.00	0.13
164	600011	华能国际	50,700	487,734.00	0.13
165	688256	寒武纪	2,448	486,344.16	0.12
166	00288	万洲国际	103,500	485,536.63	0.12
167	00066	港铁公司	21,500	483,697.58	0.12
168	002028	思源电气	7,200	481,680.00	0.12
169	00836	华润电力	22,000	480,891.09	0.12
170	002252	上海莱士	61,200	478,584.00	0.12
171	601916	浙商银行	171,840	474,278.40	0.12
172	600015	华夏银行	73,600	471,040.00	0.12
173	600009	上海机场	14,300	461,175.00	0.12
174	02319	蒙牛乳业	36,000	459,990.72	0.12
175	600426	华鲁恒升	17,260	459,806.40	0.12
176	600958	东方证券	60,420	459,192.00	0.12

177	00762	中国联通	70,000	458,074.09	0.12
178	02331	李宁	29,500	455,016.61	0.12
179	601186	中国铁建	52,900	453,353.00	0.12
180	300408	三环集团	15,500	452,445.00	0.12
181	002311	海大集团	9,600	451,680.00	0.12
182	000166	申万宏源	104,200	449,102.00	0.12
183	00291	华润啤酒	18,500	443,220.23	0.11
184	000157	中联重科	57,400	440,832.00	0.11
185	600989	宝丰能源	25,300	438,449.00	0.11
186	601901	方正证券	56,500	436,745.00	0.11
187	000977	浪潮信息	11,900	432,803.00	0.11
188	601058	赛轮轮胎	30,400	425,600.00	0.11
189	600674	川投能源	22,500	421,875.00	0.11
190	003816	中国广核	91,100	421,793.00	0.11
191	300433	蓝思科技	23,000	419,750.00	0.11
192	688271	联影医疗	3,797	416,530.90	0.11
193	01928	金沙中国有限公司	28,000	416,036.05	0.11
194	688169	石头科技	1,058	415,370.80	0.11
195	000776	广发证券	34,100	414,997.00	0.11
196	09868	小鹏汽车-W	15,300	412,636.32	0.11
197	002049	紫光国微	7,840	412,384.00	0.11
198	002001	新和成	21,400	410,880.00	0.11
199	601377	兴业证券	79,610	402,826.60	0.10
200	000596	古井贡酒	1,900	401,033.00	0.10
201	688036	传音控股	5,196	397,701.84	0.10
202	01997	九龙仓置业	21,000	396,742.00	0.10
203	600115	中国东航	98,700	395,787.00	0.10
204	601111	中国国航	53,500	394,830.00	0.10
205	002422	科伦药业	13,000	394,290.00	0.10
206	02382	舜宇光学科技	8,800	387,523.93	0.10
207	09626	哔哩哔哩-W	3,340	386,835.77	0.10
208	300122	智飞生物	13,750	385,412.50	0.10
209	000768	中航西飞	16,000	384,480.00	0.10
210	002340	格林美	59,200	377,104.00	0.10
211	601825	沪农商行	55,700	374,304.00	0.10
212	600160	巨化股份	15,500	374,015.00	0.10
213	00285	比亚迪电子	10,500	373,742.46	0.10
214	002460	赣锋锂业	12,980	371,877.00	0.10
215	00135	昆仑能源	50,000	369,635.40	0.09
216	601800	中国交建	41,200	368,328.00	0.09
217	00083	信和置业	50,000	367,353.70	0.09
218	600029	南方航空	62,100	365,769.00	0.09
219	001979	招商蛇口	41,600	365,664.00	0.09

220	600010	包钢股份	259,700	363,580.00	0.09
221	01821	ESR	38,800	363,326.96	0.09
222	601633	长城汽车	14,300	361,790.00	0.09
223	601077	渝农商行	71,800	360,436.00	0.09
224	002601	龙佰集团	19,200	356,544.00	0.09
225	600256	广汇能源	53,200	356,440.00	0.09
226	002466	天齐锂业	11,900	355,929.00	0.09
227	002648	卫星化学	19,532	351,185.36	0.09
228	002236	大华股份	22,700	350,942.00	0.09
229	601117	中国化学	42,200	347,728.00	0.09
230	000786	北新建材	11,700	347,022.00	0.09
231	603799	华友钴业	15,590	345,006.70	0.09
232	01038	长江基建集团	8,500	342,118.10	0.09
233	01378	中国宏桥	31,500	339,818.14	0.09
234	000661	长春高新	3,700	339,549.00	0.09
234	002493	荣盛石化	35,150	339,549.00	0.09
235	600346	恒力石化	24,300	338,985.00	0.09
236	000983	山西焦煤	32,800	338,168.00	0.09
237	603369	今世缘	7,300	337,260.00	0.09
238	300394	天孚通信	3,800	335,996.00	0.09
239	600372	中航机载	28,046	335,710.62	0.09
240	600161	天坛生物	13,680	333,792.00	0.09
241	06862	海底捞	26,000	333,164.71	0.09
242	300782	卓胜微	4,284	333,038.16	0.09
243	601838	成都银行	21,900	332,661.00	0.09
244	600023	浙能电力	46,600	331,326.00	0.09
245	601788	光大证券	22,500	328,950.00	0.08
246	688223	晶科能源	46,156	327,707.60	0.08
247	002384	东山精密	15,800	327,060.00	0.08
248	00020	商汤-W	271,000	326,483.89	0.08
249	00012	恒基地产	17,000	325,050.98	0.08
250	600196	复星医药	14,600	323,244.00	0.08
251	000807	云铝股份	23,900	322,889.00	0.08
252	002938	鹏鼎控股	8,100	322,056.00	0.08
253	002129	TCL 中环	37,175	321,563.75	0.08
254	600845	宝信软件	10,029	320,225.97	0.08
255	601872	招商轮船	37,800	319,410.00	0.08
256	300418	昆仑万维	9,900	319,176.00	0.08
257	000630	铜陵有色	88,100	318,041.00	0.08
258	01177	中国生物制药	130,000	316,791.23	0.08
259	601868	中国能建	149,300	316,516.00	0.08
260	601360	三六零	41,100	315,648.00	0.08
261	601021	春秋航空	5,600	315,448.00	0.08

262	000975	山金国际	19,300	314,397.00	0.08
263	300661	圣邦股份	3,787	313,487.86	0.08
264	600233	圆通速递	19,900	311,435.00	0.08
265	601233	桐昆股份	19,400	309,624.00	0.08
266	01308	海丰国际	16,000	309,581.06	0.08
267	600219	南山铝业	81,200	309,372.00	0.08
268	600570	恒生电子	17,512	309,261.92	0.08
269	600176	中国巨石	27,694	306,018.70	0.08
270	600085	同仁堂	8,000	305,680.00	0.08
271	002180	纳思达	11,500	303,830.00	0.08
272	00960	龙湖集团	31,000	303,301.82	0.08
273	605499	东鹏饮料	1,400	302,050.00	0.08
274	002625	光启技术	17,300	300,155.00	0.08
275	601995	中金公司	10,100	299,061.00	0.08
276	600741	华域汽车	18,200	298,116.00	0.08
277	300347	泰格医药	6,100	296,460.00	0.08
278	300896	爱美客	1,720	296,012.00	0.08
279	002736	国信证券	33,300	289,377.00	0.07
280	601100	恒立液压	6,200	288,796.00	0.07
281	600183	生益科技	13,700	288,522.00	0.07
282	601336	新华保险	9,600	288,288.00	0.07
283	603392	万泰生物	4,363	287,434.44	0.07
284	601066	中信建投	14,900	286,676.00	0.07
285	06618	京东健康	14,750	286,068.14	0.07
286	600096	云天化	14,700	285,474.00	0.07
287	600745	闻泰科技	10,100	285,325.00	0.07
288	000895	双汇发展	12,000	285,240.00	0.07
289	002271	东方雨虹	23,100	285,054.00	0.07
290	600362	江西铜业	12,000	284,160.00	0.07
291	601689	拓普集团	5,300	284,133.00	0.07
292	000963	华东医药	10,100	280,881.00	0.07
293	00004	九龙仓集团	14,000	280,466.56	0.07
294	001965	招商公路	23,600	279,896.00	0.07
295	002920	德赛西威	3,200	278,688.00	0.07
296	00268	金蝶国际	41,000	273,913.52	0.07
297	600027	华电国际	39,200	272,048.00	0.07
298	601881	中国银河	24,900	270,414.00	0.07
299	601555	东吴证券	45,778	270,090.20	0.07
300	688777	中控技术	7,119	268,386.30	0.07
301	01193	华润燃气	10,700	267,091.24	0.07
302	600885	宏发股份	9,620	266,281.60	0.07
303	03800	协鑫科技	249,000	263,618.49	0.07
304	601898	中煤能源	21,100	263,328.00	0.07

305	688126	沪硅产业	18,904	261,064.24	0.07
306	300033	同花顺	2,500	259,250.00	0.07
307	603605	珀莱雅	2,300	255,277.00	0.07
308	002459	晶澳科技	22,784	255,180.80	0.07
309	000999	华润三九	5,980	254,628.40	0.07
310	002916	深南电路	2,400	253,848.00	0.07
311	601618	中国中冶	81,700	253,270.00	0.07
312	00019	太古股份公司 A	4,000	251,899.68	0.06
313	601108	财通证券	37,840	250,122.40	0.06
314	600026	中远海能	16,000	249,760.00	0.06
315	601699	潞安环能	13,700	248,381.00	0.06
316	600515	海南机场	78,600	246,804.00	0.06
317	601607	上海医药	12,800	244,608.00	0.06
318	600482	中国动力	12,500	243,500.00	0.06
319	300832	新产业	3,600	242,784.00	0.06
320	00384	中国燃气	38,000	242,772.88	0.06
321	600765	中航重机	11,900	242,760.00	0.06
322	000301	东方盛虹	30,400	242,288.00	0.06
323	000876	新希望	26,300	240,382.00	0.06
324	601878	浙商证券	22,300	239,056.00	0.06
325	600039	四川路桥	30,260	238,751.40	0.06
326	600332	白云山	8,100	237,573.00	0.06
327	002074	国轩高科	12,400	237,460.00	0.06
328	601877	正泰电器	12,400	236,344.00	0.06
329	002602	世纪华通	68,900	236,327.00	0.06
330	600875	东方电气	12,800	236,160.00	0.06
331	600588	用友网络	23,536	235,360.00	0.06
332	600415	小商品城	31,600	234,472.00	0.06
333	002555	三七互娱	17,900	233,595.00	0.06
334	03311	中国建筑国际	24,000	233,500.05	0.06
335	002600	领益智造	32,600	232,112.00	0.06
336	002709	天赐材料	13,200	231,792.00	0.06
337	603606	东方电缆	4,700	229,407.00	0.06
338	00868	信义玻璃	29,000	226,563.68	0.06
339	03888	金山软件	11,000	226,390.27	0.06
340	600803	新奥股份	10,800	224,640.00	0.06
341	600025	华能水电	20,800	224,224.00	0.06
342	300003	乐普医疗	15,100	224,084.00	0.06
343	00322	康师傅控股	26,000	223,296.29	0.06
344	00968	信义光能	62,000	222,383.61	0.06
345	03998	波司登	50,000	222,237.58	0.06
346	688396	华润微	5,931	222,056.64	0.06
347	000408	藏格矿业	9,100	219,037.00	0.06

348	300628	亿联网络	5,940	218,413.80	0.06
349	002812	恩捷股份	6,900	218,385.00	0.06
350	300316	晶盛机电	7,600	218,348.00	0.06
351	601727	上海电气	58,800	217,560.00	0.06
352	002202	金风科技	31,700	213,024.00	0.05
353	000932	华菱钢铁	48,000	212,640.00	0.05
354	688599	天合光能	12,549	212,329.08	0.05
355	00241	阿里健康	74,000	211,394.94	0.05
356	300450	先导智能	12,680	210,868.40	0.05
357	300223	北京君正	3,800	210,672.00	0.05
358	300142	沃森生物	18,500	210,530.00	0.05
359	03692	翰森制药	14,000	208,529.13	0.05
360	06186	中国飞鹤	63,000	207,570.81	0.05
361	600460	士兰微	11,600	203,116.00	0.05
362	688122	西部超导	5,248	201,103.36	0.05
363	002007	华兰生物	12,700	200,533.00	0.05
364	605117	德业股份	2,696	200,420.64	0.05
365	600298	安琪酵母	7,100	198,303.00	0.05
366	09896	名创优品	5,800	198,243.22	0.05
367	601615	明阳智能	20,900	197,296.00	0.05
368	000066	中国长城	22,500	196,875.00	0.05
369	601238	广汽集团	25,400	196,596.00	0.05
370	300751	迈为股份	1,620	193,557.60	0.05
371	300759	康龙化成	10,375	192,767.50	0.05
372	301269	华大九天	2,500	192,625.00	0.05
373	603260	合盛硅业	4,100	191,511.00	0.05
374	300496	中科创达	4,200	191,478.00	0.05
375	601319	中国人保	37,000	190,550.00	0.05
376	300999	金龙鱼	6,900	188,715.00	0.05
377	600018	上港集团	32,500	187,850.00	0.05
378	688072	拓荆科技	1,554	186,650.94	0.05
379	000783	长江证券	38,600	186,438.00	0.05
380	603816	顾家家居	5,730	185,021.70	0.05
381	01044	恒安国际	8,500	184,635.16	0.05
382	01209	华润万象生活	7,800	184,023.67	0.05
383	000733	振华科技	4,400	182,732.00	0.05
384	600918	中泰证券	32,200	182,574.00	0.05
385	300413	芒果超媒	8,700	181,830.00	0.05
386	06969	思摩尔国际	21,000	181,504.67	0.05
387	688009	中国通号	29,920	179,520.00	0.05
388	601799	星宇股份	1,600	179,264.00	0.05
389	688180	君实生物	6,164	179,064.20	0.05
390	002821	凯莱英	2,720	178,976.00	0.05

391	01929	周大福	23,200	178,921.79	0.05
392	603806	福斯特	12,118	178,134.60	0.05
393	03808	中国重汽	9,500	176,010.34	0.05
394	02618	京东物流	23,000	175,909.94	0.05
395	601865	福莱特	8,700	174,870.00	0.04
396	603659	璞泰来	12,346	174,448.98	0.04
397	601696	中银证券	19,200	174,336.00	0.04
398	300037	新宙邦	6,100	174,216.00	0.04
399	603939	益丰药房	7,091	174,084.05	0.04
400	00316	东方海外国际	1,500	173,454.83	0.04
401	00881	中升控股	16,500	171,976.29	0.04
402	603195	公牛集团	2,220	171,206.40	0.04
403	603345	安井食品	2,300	170,913.00	0.04
404	600132	重庆啤酒	2,800	169,960.00	0.04
405	600061	国投资本	30,000	169,500.00	0.04
406	300919	中伟股份	5,400	167,346.00	0.04
407	688506	百利天恒	917	166,343.80	0.04
408	01876	百威亚太	19,700	165,414.12	0.04
409	002064	华峰化学	22,800	163,476.00	0.04
410	688047	龙芯中科	1,833	161,175.69	0.04
411	603589	口子窖	4,100	160,679.00	0.04
412	000617	中油资本	29,000	160,080.00	0.04
413	300146	汤臣倍健	11,800	159,890.00	0.04
414	601059	信达证券	11,200	159,152.00	0.04
415	000708	中信特钢	11,700	158,769.00	0.04
416	00270	粤海投资	38,000	158,496.01	0.04
417	601966	玲珑轮胎	8,500	156,145.00	0.04
418	603198	迎驾贡酒	2,700	155,250.00	0.04
419	601018	宁波港	45,100	153,340.00	0.04
420	600702	舍得酒业	2,700	153,009.00	0.04
421	688303	大全能源	7,473	152,374.47	0.04
422	01972	太古地产	13,400	152,140.11	0.04
423	002603	以岭药业	9,800	150,234.00	0.04
424	688187	时代电气	3,016	148,930.08	0.04
425	00144	招商局港口	14,000	148,474.78	0.04
426	300454	深信服	2,900	146,537.00	0.04
427	002410	广联达	15,140	145,041.20	0.04
428	300144	宋城演艺	18,000	144,540.00	0.04
429	300442	润泽科技	6,000	143,700.00	0.04
430	601216	君正集团	38,500	142,065.00	0.04
431	002841	视源股份	4,800	141,744.00	0.04
432	000723	美锦能源	29,600	140,896.00	0.04
433	01548	金斯瑞生物科技	18,000	136,682.96	0.04

434	06110	滔搏	36,000	136,354.39	0.04
435	000629	钒钛股份	54,000	135,000.00	0.03
436	603899	晨光股份	4,200	131,376.00	0.03
437	601136	首创证券	6,400	130,944.00	0.03
438	00101	恒隆地产	21,000	127,647.42	0.03
439	01585	雅迪控股	14,000	126,114.12	0.03
440	002939	长城证券	18,500	123,950.00	0.03
441	601231	环旭电子	7,700	123,585.00	0.03
442	688363	华熙生物	2,178	123,209.46	0.03
443	603486	科沃斯	2,600	122,668.00	0.03
444	300601	康泰生物	7,840	122,382.40	0.03
445	600754	锦江酒店	5,300	121,794.00	0.03
446	603290	斯达半导	1,400	120,554.00	0.03
447	002414	高德红外	19,905	117,240.45	0.03
448	601808	中海油服	6,800	116,960.00	0.03
449	000069	华侨城 A	56,100	114,444.00	0.03
450	600732	爱旭股份	12,600	114,030.00	0.03
451	00017	新世界发展	17,000	113,418.74	0.03
452	603833	欧派家居	2,100	112,476.00	0.03
453	300763	锦浪科技	2,700	112,428.00	0.03
454	300979	华利集团	1,800	109,530.00	0.03
455	00293	国泰航空	15,000	109,384.70	0.03
456	688728	格科微	8,995	108,929.45	0.03
457	000877	天山股份	19,800	106,920.00	0.03
458	01066	威高股份	30,800	104,571.22	0.03
459	601698	中国卫通	7,400	104,266.00	0.03
460	002568	百润股份	6,040	101,653.20	0.03
461	002080	中材科技	7,800	100,620.00	0.03
462	300957	贝泰妮	2,000	96,640.00	0.02
463	603688	石英股份	3,100	91,791.00	0.02
464	002032	苏泊尔	1,800	90,180.00	0.02
465	000987	越秀资本	17,630	87,444.80	0.02
466	603737	三棵树	2,400	87,048.00	0.02
467	603882	金域医学	3,200	87,008.00	0.02
468	688082	盛美上海	912	77,073.12	0.02
469	688561	奇安信	3,007	71,025.34	0.02
470	600377	宁沪高速	5,600	70,560.00	0.02
471	600606	绿地控股	48,100	64,935.00	0.02
472	001872	招商港口	2,700	51,975.00	0.01
473	601061	中信金属	6,400	43,968.00	0.01
474	002945	华林证券	3,200	31,936.00	0.01
475	001289	龙源电力	1,700	29,325.00	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	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.04
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
3	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
4	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
5	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	02057	中通快递-W	929,164.01	0.22
2	300502	新易盛	924,439.00	0.22
3	600900	长江电力	840,404.00	0.20
4	600519	贵州茅台	813,890.00	0.20
5	00700	腾讯控股	793,520.34	0.19
6	01519	极兔速递-W	779,673.47	0.19
7	002463	沪电股份	573,334.00	0.14
8	002028	思源电气	528,800.00	0.13
9	00005	汇丰控股	468,676.71	0.11
10	601058	赛轮轮胎	444,681.00	0.11
11	688169	石头科技	440,493.88	0.11
12	601998	中信银行	412,062.20	0.10
12	00998	中信银行	13,184.26	0.00
13	002422	科伦药业	420,371.00	0.10
14	600256	广汇能源	409,976.00	0.10
15	300394	天孚通信	373,790.40	0.09
16	300418	昆仑万维	336,287.00	0.08
17	000975	山金国际	327,086.00	0.08
18	000630	铜陵有色	324,754.00	0.08
19	001965	招商公路	273,406.00	0.07
20	601006	大秦铁路	271,860.00	0.07

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	00700	腾讯控股	3,421,902.52	0.82
2	00941	中国移动	2,403,635.18	0.58

2	600941	中国移动	10,033.00	0.00
3	02888	渣打集团	2,287,212.64	0.55
4	00005	汇丰控股	2,216,448.63	0.53
5	01299	友邦保险	1,055,301.70	0.25
6	03690	美团-W	917,812.03	0.22
7	00939	建设银行	871,275.97	0.21
7	601939	建设银行	4,218.00	0.00
8	300750	宁德时代	823,121.00	0.20
9	01211	比亚迪股份	382,960.39	0.09
9	002594	比亚迪	326,801.00	0.08
10	01398	工商银行	512,416.79	0.12
10	601398	工商银行	9,288.00	0.00
11	000333	美的集团	509,366.00	0.12
12	600028	中国石化	314,708.00	0.08
12	00386	中国石油化工股份	180,867.33	0.04
13	00883	中国海洋石油	464,491.32	0.11
13	600938	中国海油	11,957.00	0.00
14	00388	香港交易所	449,381.89	0.11
15	000858	五粮液	435,352.00	0.10
16	02318	中国平安	397,237.21	0.10
16	601318	中国平安	20,802.00	0.01
17	01810	小米集团-W	413,519.39	0.10
18	300760	迈瑞医疗	412,373.00	0.10
19	03988	中国银行	399,383.74	0.10
19	601988	中国银行	5,340.00	0.00
20	601998	中信银行	337,055.00	0.08
20	00998	中信银行	62,514.12	0.02

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	25,601,041.46
卖出股票收入（成交）总额	44,661,062.47

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	11,625.33
2	应收清算款	2,638,710.06
3	应收股利	814,509.71
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	3,464,845.10

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股流通受限
2	301565	中仑新材	13,494.78	0.00	新股流通受限
3	301580	爱迪特	13,317.86	0.00	新股流通受限
4	301392	汇成真空	9,123.54	0.00	新股流通受限
5	603381	永臻股份	4,473.14	0.00	新股流通受限

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 (%)
13,768	40,513.73	20,107,102.00	3.60	537,685,898.00	96.40

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	竞技世界(北京)网络技术有限公司	5,000,000.00	0.90
2	方正证券股份有限公司	4,816,400.00	0.86
3	霍尔果斯两比特科技有限公司	3,756,600.00	0.67
4	王庆彦	3,139,600.00	0.56
5	但钧	3,000,000.00	0.54
5	那秀影	3,000,000.00	0.54
5	郑碧珍	3,000,000.00	0.54
8	王东博	2,952,800.00	0.53
9	陈家榕	2,548,000.00	0.46

10	中信建投证券股份有限公司	2,067,502.00	0.37
----	--------------	--------------	------

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（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	1,482,793,000.00
本报告期期初基金份额总额	617,793,000.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	70,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	557,793,000.00

§ 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	6	47,696,637.41	68.14	17,500.17	70.35	-
广发证券	6	11,295,378.40	16.14	3,622.34	14.56	新增2个交易单元
东方证券	2	11,002,770.73	15.72	3,752.77	15.09	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-

开源证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-

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

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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东方财 富	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

国融证 券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 12 日
2	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2023 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 1 月 12 日
3	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 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
5	《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
6	《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
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 19 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换 (如有) 及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 27 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 29 日
10	《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
11	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
12	《银华中证沪港深 500 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
13	《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
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗	本基金管理人网站, 中	2024 年 5 月 13 日

	下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	
15	《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
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 6 月 27 日
17	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
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 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日