

银华 MSCI 中国 A 股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：中国工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。

基金托管人中国工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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	MSCI 中国
场内简称	MSCI 中国（扩位证券简称：MSCI 中国 ETF）
基金主代码	512380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	120,805,582.00 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	2019 年 4 月 30 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>本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。</p> <p>本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，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财产的 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	MSCI 中国 A 股人民币指数收益率
风险收益特征	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与货币市场基金。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。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95588
传真		(010) 58163027	(010) 66105798
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	廖林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-6,678,447.72
本期利润	753,749.55
加权平均基金份额本期利润	0.0061
本期加权平均净值利润率	0.52%
本期基金份额净值增长率	0.57%
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	19,874,303.98
期末可供分配基金份额利润	0.1645
期末基金资产净值	140,679,885.98
期末基金份额净值	1.1645
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	16.45%

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。

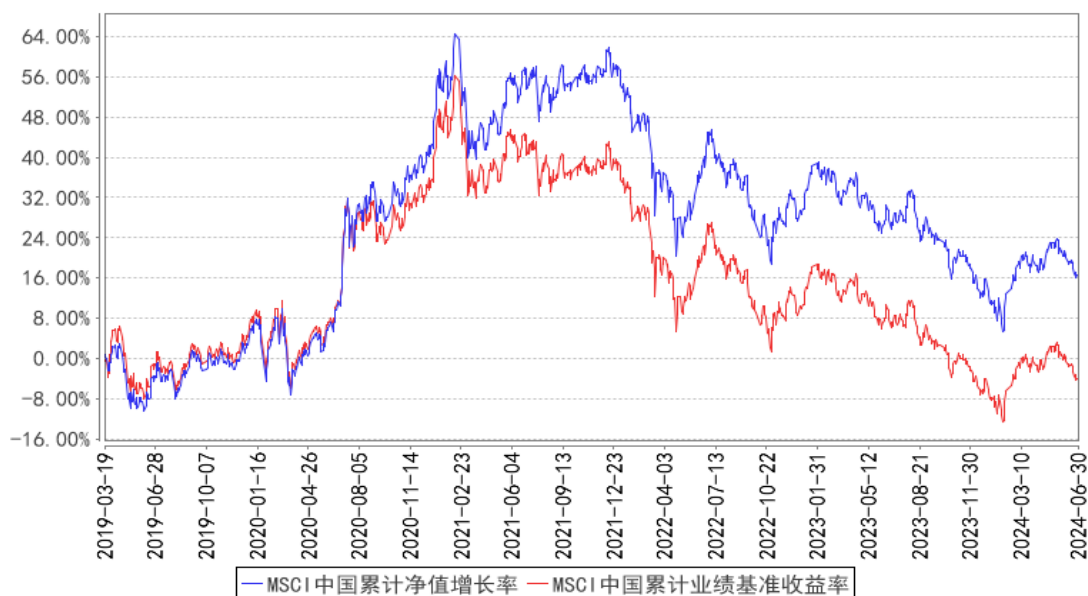
## 3.2 基金净值表现

### 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	-3.17%	0.50%	-3.88%	0.51%	0.71%	-0.01%
过去三个月	-1.74%	0.77%	-2.61%	0.79%	0.87%	-0.02%
过去六个月	0.57%	0.97%	0.00%	0.98%	0.57%	-0.01%
过去一年	-8.48%	0.89%	-10.40%	0.91%	1.92%	-0.02%
过去三年	-26.18%	1.01%	-33.59%	1.04%	7.41%	-0.03%
自基金合同生效起至今	16.45%	1.14%	-4.04%	1.17%	20.49%	-0.03%

### 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

MSCI 中国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财产的 80%，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		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2019年3月19日	-	15.5年	硕士学位。毕业于中国人民大学。2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职，自2011年9月26日起至2014年1月6日期间担任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2012年8月23日至2020年11月26日兼任上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2012年8月29日至2021年1月7日兼任银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2013年5月22日至2016年4月25日兼任银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金经理，自2014年1月7日至2018年3月7日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金（由银华沪深300指数证券投资基金（LOF）转型）基金经理，自2016年1月14日至2018年3月7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2017年9月15日至2018年12月26日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、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2017年11月9日至2018年12月26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1月18日至2021年6月18日兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理，自2018年10月22日起兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2018年11月15日至2023年3月21日兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2019年3月19日起兼任银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年6月5日至2022年8月5日兼任银华MSCI中国A股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2月18日起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。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 MSCI 中国 A 股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 1.1645 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，业绩比较基准收益率为 0.00%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,752,871.36	2,714,134.09
结算备付金		517,199.16	1,391,703.71
存出保证金		118,261.84	134,617.26
交易性金融资产	6.4.7.2	136,573,946.89	149,965,315.62
其中：股票投资		136,573,946.89	149,965,315.62
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	75,410.15	-
资产总计		141,037,689.40	154,205,770.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4.30	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		57,678.83	64,099.80
应付托管费		11,535.76	12,819.97
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	288,584.53	349,909.19
负债合计		357,803.42	426,828.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	120,805,582.00	132,805,582.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,874,303.98	20,973,359.72
净资产合计		140,679,885.98	153,778,941.72
负债和净资产总计		141,037,689.40	154,205,770.68

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1645 元，基金份额总额 120,805,582.00



份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股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
<b>一、营业总收入</b>		1,412,546.78	-1,402,654.59
1. 利息收入		11,757.52	21,981.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,757.52	21,981.01
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）		-6,065,110.12	201,669.49
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,710,514.41	-1,756,652.31
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	-35,692.04	48,469.02
股利收益	6.4.7.19	1,681,096.33	1,909,852.78
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	7,432,197.27	-1,609,890.50
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	33,702.11	-16,414.59
<b>减：二、营业总支出</b>		658,797.23	781,280.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	357,143.34	440,828.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	71,428.68	88,165.63
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		-	174.96
8. 其他费用	6.4.7.23	230,225.21	252,111.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		753,749.55	-2,183,935.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		753,749.55	-2,183,935.28
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		753,749.55	-2,183,935.28

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股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	132,805,582.00	-	20,973,359.72	153,778,941.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	132,805,582.00	-	20,973,359.72	153,778,941.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,000,000.00	-	-1,099,055.74	-13,099,055.74
（一）、综合收益总额	-	-	753,749.55	753,749.55
（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）	-12,000,000.00	-	-1,852,805.29	-13,852,805.29
其中：1. 基金申	3,000,000.00	-	508,336.90	3,508,336.90

购款				
2. 基金赎回款	-15,000,000.00	-	-2,361,142.19	-17,361,142.19
(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	120,805,582.00	-	19,874,303.98	140,679,885.98
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	138,805,582.00	-	40,410,787.19	179,216,369.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	138,805,582.00	-	40,410,787.19	179,216,369.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,000,000.00	-	-4,231,971.59	-10,231,971.59
(一)、综合收益总额	-	-	-2,183,935.28	-2,183,935.28
(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	-	-2,048,036.31	-8,048,036.31
其中：1. 基金申购款	9,000,000.00	-	2,697,178.75	11,697,178.75
2. 基金赎回款	-15,000,000.00	-	-4,745,215.06	-19,745,215.06
(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	-	-	-	-

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	132,805,582.00	-	36,178,815.60	168,984,397.60

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2018]1209 号文批准公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 2,058,805,582.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)正式生效。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》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。在建仓完成后,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财产的 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核准上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、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、股指期货、权证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标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股人民币指数，英文全称为：MSCI China A RMB Index，指数代码为：718711。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《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]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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;
- (2) 对证券投资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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税; 自 2023 年 8 月 28 日起, 出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。
- (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	3,752,871.36
等于：本金	3,752,531.14
加：应计利息	340.22
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	3,752,871.36

#### 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	154,914,024.36	-	136,573,946.89	-18,340,077.47
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	154,914,024.36	-	136,573,946.89	-18,340,077.47

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,027,000.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	1,027,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,027,000.00	-	-	-

##### 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
IC2412	IC2412	1.00	966,760.00	-60,240.00
合计				-60,240.00
减：可抵销期货 暂收款				-60,240.00
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

单位：人民币元

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

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,343.89
其中：交易所市场	5,343.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	198,705.28
合计	288,584.53

## 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	132,805,582.00	132,805,582.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-15,000,000.00	-15,000,000.00
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	120,805,582.00	120,805,582.00

## 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	93,609,689.01	-72,636,329.29	20,973,359.72
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	93,609,689.01	-72,636,329.29	20,973,359.72
本期利润	-6,678,447.72	7,432,197.27	753,749.55
本期基金份额交易产生的变动数	-8,311,039.03	6,458,233.74	-1,852,805.29
其中:基金申购款	1,944,951.34	-1,436,614.44	508,336.90
基金赎回款	-10,255,990.37	7,894,848.18	-2,361,142.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,620,202.26	-58,745,898.28	19,874,303.98

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	4,366.51
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	7,361.25
其他	29.76
合计	11,757.52

#### 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	-6,689,105.64
股票投资收益——赎回差价收入	-1,021,408.77
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	-7,710,514.41

#### 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	16,083,839.35
减：卖出股票成本总额	22,753,937.21
减：交易费用	19,007.78
买卖股票差价收入	-6,689,105.64

#### 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	17,361,142.19
减：现金支付赎回款总额	6,871,332.19
减：赎回股票成本总额	11,511,218.77
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,021,408.77

#### 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	-35,692.04

## 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	1,681,096.33

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	1,681,096.33

#### 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	7,482,837.27
股票投资	7,482,837.27
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	-50,640.00
权证投资	-
期货投资	-50,640.00
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	7,432,197.27

#### 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	33,702.11
合计	33,702.11

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	258.00
指数使用费	70,842.00
其他	74,589.85

合计	230,225.21
----	------------

#### 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
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	357,143.34	440,828.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,723.52	10,051.93
应支付基金管理人的净管理费	350,419.82	430,776.19

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	71,428.68	88,165.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
西南证券	14,584.00	0.01	14,584.00	0.01

**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
中国工商银行	3,752,871.36	4,366.51	5,024,778.67	8,470.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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（中国工商银行股份有限公司）发行的股票：工商银行（代码 601398）267,844.00 股，期末公允价值为人民币 1,526,710.80 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.09%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东（第一创业证券股份有限公司）发行的股票：第一创业（代码 002797）27,333.00 股，期末公允价值为人民币 139,124.97 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.10%。



本基金本报告期末投资于基金管理人股东（西南证券股份有限公司）发行的股票：西南证券（代码 600369）24,200.00 股，期末公允价值为人民币 86,636.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.06%。

#### 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										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	684	12,756.60	12,756.60	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	77	1,436.05	1,436.05	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	64	1,494.40	1,608.32	-

##### 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	3,752,871.36	-	-	-	3,752,871.36
结算备付金	517,199.16	-	-	-	517,199.16
存出保证金	118,261.84	-	-	-	118,261.84
交易性金融资产	-	-	-	136,573,946.89	136,573,946.89
其他资产	-	-	-	75,410.15	75,410.15
资产总计	4,388,332.36	-	-	136,649,357.04	141,037,689.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	57,678.83	57,678.83
应付托管费	-	-	-	11,535.76	11,535.76
应付清算款	-	-	-	4.30	4.30
其他负债	-	-	-	288,584.53	288,584.53
负债总计	-	-	-	357,803.42	357,803.42
利率敏感度缺口	4,388,332.36	-	-	136,291,553.62	140,679,885.98
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	2,714,134.09	-	-	-	2,714,134.09
结算备付金	1,391,703.71	-	-	-	1,391,703.71
存出保证金	134,617.26	-	-	-	134,617.26
交易性金融资产	-	-	-	-149,965,315.62	149,965,315.62
资产总计	4,240,455.06	-	-	-149,965,315.62	154,205,770.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	64,099.80	64,099.80
应付托管费	-	-	-	12,819.97	12,819.97
其他负债	-	-	-	349,909.19	349,909.19
负债总计	-	-	-	426,828.96	426,828.96
利率敏感度缺口	4,240,455.06	-	-	-149,538,486.66	153,778,941.72

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	136,573,946.89	97.08	149,965,315.62	97.52

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	136,573,946.89	97.08	149,965,315.62	97.52

#### 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%	6,870,158.41	7,444,992.98
	业绩比较基准下降 5%	-6,870,158.41	-7,444,992.98

#### 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	136,558,145.92	149,814,316.08
第二层次	14,192.65	-
第三层次	1,608.32	150,999.54
合计	136,573,946.89	149,965,315.62

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

## 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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 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	136,573,946.89	96.84
	其中：股票	136,573,946.89	96.84
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	4,270,070.52	3.03
8	其他各项资产	193,671.99	0.14
9	合计	141,037,689.40	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	1,433,717.65	1.02
B	采矿业	8,819,963.17	6.27
C	制造业	73,387,542.97	52.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,118,714.14	5.06
E	建筑业	2,843,654.43	2.02
F	批发和零售业	1,033,429.55	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	5,733,651.08	4.08
H	住宿和餐饮业	90,288.42	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,796,617.74	3.41
J	金融业	27,398,633.17	19.48
K	房地产业	1,283,327.40	0.91
L	租赁和商务服务业	1,016,636.02	0.72
M	科学研究和技术服务业	533,391.95	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	129,077.76	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	396,640.96	0.28
R	文化、体育和娱乐业	464,715.51	0.33
S	综合	78,144.00	0.06
	合计	136,558,145.92	97.07

### 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	15,800.97	0.01
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	15,800.97	0.01

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,620	6,779,341.80	4.82
2	300750	宁德时代	16,030	2,885,880.90	2.05
3	600900	长江电力	89,296	2,582,440.32	1.84
4	600036	招商银行	75,278	2,573,754.82	1.83
5	000858	五粮液	17,319	2,217,524.76	1.58
6	002594	比亚迪	6,696	1,675,674.00	1.19
7	601318	中国平安	39,274	1,624,372.64	1.15
8	601398	工商银行	267,844	1,526,710.80	1.09



9	601288	农业银行	345,348	1,505,717.28	1.07
10	601166	兴业银行	75,818	1,335,913.16	0.95
11	601138	工业富联	48,405	1,326,297.00	0.94
12	601899	紫金矿业	75,116	1,319,788.12	0.94
13	300760	迈瑞医疗	4,447	1,293,676.77	0.92
14	601816	京沪高铁	208,000	1,116,960.00	0.79
15	601328	交通银行	143,204	1,069,733.88	0.76
16	601088	中国神华	24,092	1,068,962.04	0.76
17	002475	立讯精密	26,243	1,031,612.33	0.73
18	600809	山西汾酒	4,468	942,211.84	0.67
19	600309	万华化学	11,547	933,690.42	0.66
20	601225	陕西煤业	35,357	911,149.89	0.65
21	600276	恒瑞医药	23,333	897,387.18	0.64
22	600000	浦发银行	107,149	881,836.27	0.63
23	002714	牧原股份	19,988	871,476.80	0.62
24	601857	中国石油	84,014	867,024.48	0.62
25	000333	美的集团	12,700	819,150.00	0.58
26	600030	中信证券	44,706	814,990.38	0.58
27	601668	中国建筑	151,868	806,419.08	0.57
28	600028	中国石化	125,241	791,523.12	0.56
29	000568	泸州老窖	5,390	773,411.10	0.55
30	000725	京东方 A	186,525	762,887.25	0.54
31	601985	中国核电	68,938	734,879.08	0.52
32	600406	国电南瑞	29,330	732,076.80	0.52
33	601766	中国中车	96,790	726,892.90	0.52
34	601919	中远海控	46,531	720,765.19	0.51
35	000001	平安银行	70,884	719,472.60	0.51
36	601601	中国太保	25,091	699,035.26	0.50
37	601988	中国银行	151,120	698,174.40	0.50
38	600150	中国船舶	16,324	664,550.04	0.47
39	600690	海尔智家	23,037	653,790.06	0.46
40	002352	顺丰控股	17,889	638,458.41	0.45
41	002371	北方华创	1,927	616,428.03	0.44
42	300059	东方财富	57,572	607,960.32	0.43
43	600887	伊利股份	23,226	600,159.84	0.43
44	688041	海光信息	8,500	597,720.00	0.42
45	601658	邮储银行	117,883	597,666.81	0.42
46	601818	光大银行	187,911	595,677.87	0.42
47	600050	中国联通	125,891	591,687.70	0.42
48	603288	海天味业	17,036	587,230.92	0.42
49	300308	中际旭创	4,198	578,820.24	0.41
50	600905	三峡能源	131,022	571,255.92	0.41
51	603993	洛阳钼业	64,510	548,335.00	0.39

52	601390	中国中铁	82,632	538,760.64	0.38
53	600019	宝钢股份	80,775	537,153.75	0.38
54	002142	宁波银行	24,146	532,660.76	0.38
55	600031	三一重工	30,957	510,790.50	0.36
56	600989	宝丰能源	29,351	508,652.83	0.36
57	601127	赛力斯	5,500	501,160.00	0.36
58	600919	江苏银行	67,054	498,211.22	0.35
59	600886	国投电力	27,200	496,128.00	0.35
60	000625	长安汽车	36,717	493,109.31	0.35
61	600016	民生银行	129,356	490,259.24	0.35
62	300498	温氏股份	24,258	480,793.56	0.34
63	601600	中国铝业	62,884	479,804.92	0.34
64	000166	申万宏源	110,788	477,496.28	0.34
65	300274	阳光电源	7,690	477,010.70	0.34
66	000063	中兴通讯	17,046	476,776.62	0.34
67	600104	上汽集团	33,851	469,174.86	0.33
68	600436	片仔癀	2,261	468,411.37	0.33
69	601006	大秦铁路	64,108	459,013.28	0.33
70	601169	北京银行	77,274	451,280.16	0.32
71	601888	中国中免	7,211	450,615.39	0.32
72	002304	洋河股份	5,546	447,784.04	0.32
73	603501	韦尔股份	4,421	439,314.77	0.31
74	000792	盐湖股份	24,300	424,035.00	0.30
75	000100	TCL 科技	98,086	423,731.52	0.30
76	000651	格力电器	10,318	404,671.96	0.29
77	000338	潍柴动力	24,817	403,028.08	0.29
78	601009	南京银行	37,783	392,565.37	0.28
79	688111	金山办公	1,721	391,527.50	0.28
80	600795	国电电力	65,059	389,703.41	0.28
81	601012	隆基绿能	27,636	387,456.72	0.28
82	600048	保利发展	43,791	383,609.16	0.27
83	600999	招商证券	27,133	377,420.03	0.27
84	601229	上海银行	51,871	376,583.46	0.27
85	002938	鹏鼎控股	9,432	375,016.32	0.27
86	601211	国泰君安	27,403	371,310.65	0.26
87	603259	药明康德	9,307	364,741.33	0.26
88	002230	科大讯飞	8,444	362,669.80	0.26
89	600547	山东黄金	13,240	362,511.20	0.26
90	600893	航发动力	9,856	360,236.80	0.26
91	600346	恒力石化	25,770	359,491.50	0.26
92	002493	荣盛石化	37,056	357,960.96	0.25
93	601669	中国电建	62,872	351,454.48	0.25
94	000425	徐工机械	49,148	351,408.20	0.25

95	600660	福耀玻璃	7,334	351,298.60	0.25
96	300015	爱尔眼科	34,029	351,179.28	0.25
97	600585	海螺水泥	14,640	345,357.60	0.25
98	000938	紫光股份	15,414	344,502.90	0.24
99	000895	双汇发展	14,380	341,812.60	0.24
100	688271	联影医疗	3,100	340,070.00	0.24
101	000538	云南白药	6,622	338,715.30	0.24
102	001979	招商蛇口	38,443	337,913.97	0.24
103	002463	沪电股份	9,220	336,530.00	0.24
104	688012	中微公司	2,366	334,221.16	0.24
105	600674	川投能源	17,793	333,618.75	0.24
106	300433	蓝思科技	18,234	332,770.50	0.24
107	601688	华泰证券	26,706	330,887.34	0.24
108	003816	中国广核	70,600	326,878.00	0.23
109	000596	古井贡酒	1,531	323,148.17	0.23
110	600011	华能国际	33,518	322,443.16	0.23
111	002027	分众传媒	52,693	319,319.58	0.23
112	600188	兖矿能源	14,006	318,356.38	0.23
113	601628	中国人寿	10,245	318,107.25	0.23
114	688256	寒武纪	1,600	317,872.00	0.23
115	688036	传音控股	4,127	315,880.58	0.22
116	600438	通威股份	16,453	314,416.83	0.22
117	601111	中国国航	42,490	313,576.20	0.22
118	600015	华夏银行	48,412	309,836.80	0.22
119	601066	中信建投	15,798	303,953.52	0.22
120	688223	晶科能源	42,500	301,750.00	0.21
121	600837	海通证券	35,239	301,645.84	0.21
122	300014	亿纬锂能	7,474	298,362.08	0.21
123	600023	浙能电力	40,800	290,088.00	0.21
124	002311	海大集团	6,126	288,228.30	0.20
125	601881	中国银河	26,453	287,279.58	0.20
126	300502	新易盛	2,700	284,985.00	0.20
127	600926	杭州银行	21,754	283,889.70	0.20
128	002736	国信证券	32,005	278,123.45	0.20
129	000921	海信家电	8,500	274,040.00	0.19
130	601868	中国能建	128,917	273,304.04	0.19
131	000776	广发证券	21,705	264,149.85	0.19
132	600489	中金黄金	17,800	263,440.00	0.19
133	601995	中金公司	8,853	262,137.33	0.19
134	601916	浙商银行	94,699	261,369.24	0.19
135	601939	建设银行	35,010	259,074.00	0.18
136	605499	东鹏饮料	1,200	258,900.00	0.18
137	600089	特变电工	18,483	256,359.21	0.18

138	601607	上海医药	13,391	255,902.01	0.18
139	600845	宝信软件	7,950	253,843.50	0.18
140	603392	万泰生物	3,850	253,638.00	0.18
141	300124	汇川技术	4,927	252,755.10	0.18
142	601872	招商轮船	29,800	251,810.00	0.18
143	600115	中国东航	62,573	250,917.73	0.18
144	000999	华润三九	5,880	250,370.40	0.18
145	000002	万 科 A	35,486	245,917.98	0.17
146	300122	智飞生物	8,734	244,814.02	0.17
147	603986	兆易创新	2,544	243,257.28	0.17
148	002241	歌尔股份	12,467	243,231.17	0.17
149	600029	南方航空	41,077	241,943.53	0.17
150	600160	巨化股份	9,906	239,031.78	0.17
151	601825	沪农商行	35,200	236,544.00	0.17
152	601727	上海电气	63,413	234,628.10	0.17
153	000963	华东医药	8,417	234,076.77	0.17
154	601901	方正证券	30,100	232,673.00	0.17
155	600010	包钢股份	165,639	231,894.60	0.16
156	688008	澜起科技	4,054	231,726.64	0.16
157	601633	长城汽车	9,129	230,963.70	0.16
158	601100	恒立液压	4,929	229,592.82	0.16
159	601336	新华保险	7,632	229,188.96	0.16
160	600111	北方稀土	13,323	229,155.60	0.16
161	601689	拓普集团	4,260	228,378.60	0.16
162	601319	中国人保	44,310	228,196.50	0.16
163	000157	中联重科	29,495	226,521.60	0.16
164	000423	东阿阿胶	3,584	224,358.40	0.16
165	601877	正泰电器	11,751	223,974.06	0.16
166	002648	卫星化学	12,319	221,495.62	0.16
167	000807	云铝股份	16,394	221,482.94	0.16
168	601618	中国中冶	70,643	218,993.30	0.16
169	002001	新 和 成	11,345	217,824.00	0.15
170	001965	招商公路	18,300	217,038.00	0.15
171	600027	华电国际	31,100	215,834.00	0.15
172	000786	北新建材	7,251	215,064.66	0.15
173	002600	领益智造	30,185	214,917.20	0.15
174	600703	三安光电	18,300	214,476.00	0.15
175	000983	山西焦煤	20,767	214,107.77	0.15
176	601838	成都银行	14,031	213,130.89	0.15
177	603369	今世缘	4,613	213,120.60	0.15
178	000617	中油资本	38,600	213,072.00	0.15
179	000630	铜陵有色	58,824	212,354.64	0.15
180	600584	长电科技	6,652	210,934.92	0.15

181	002128	电投能源	9,975	210,472.50	0.15
182	601788	光大证券	14,329	209,489.98	0.15
183	600039	四川路桥	26,547	209,455.83	0.15
184	600066	宇通客车	8,100	208,980.00	0.15
185	600958	东方证券	27,242	207,039.20	0.15
186	600426	华鲁恒升	7,761	206,753.04	0.15
187	300408	三环集团	7,052	205,847.88	0.15
188	300033	同花顺	1,971	204,392.70	0.15
189	601021	春秋航空	3,600	202,788.00	0.14
190	600332	白云山	6,863	201,291.79	0.14
191	000301	东方盛虹	25,184	200,716.48	0.14
192	601865	福莱特	9,984	200,678.40	0.14
193	601360	三六零	26,112	200,540.16	0.14
194	300832	新产业	2,963	199,824.72	0.14
195	601699	潞安环能	10,962	198,741.06	0.14
196	600803	新奥股份	9,544	198,515.20	0.14
197	600026	中远海能	12,689	198,075.29	0.14
198	002916	深南电路	1,872	198,001.44	0.14
199	600522	中天科技	12,452	197,364.20	0.14
200	000977	浪潮信息	5,411	196,798.07	0.14
201	600233	圆通速递	12,552	196,438.80	0.14
202	002028	思源电气	2,878	192,538.20	0.14
203	600600	青岛啤酒	2,628	191,239.56	0.14
204	600085	同仁堂	5,000	191,050.00	0.14
205	002252	上海莱士	24,228	189,462.96	0.13
206	600741	华域汽车	11,560	189,352.80	0.13
207	688169	石头科技	480	188,448.00	0.13
208	600875	东方电气	10,208	188,337.60	0.13
209	002236	大华股份	12,007	185,628.22	0.13
210	300896	爱美客	1,070	184,147.00	0.13
211	601117	中国化学	22,344	184,114.56	0.13
212	688396	华润微	4,903	183,568.32	0.13
213	601567	三星医疗	5,200	182,000.00	0.13
214	600183	生益科技	8,639	181,937.34	0.13
215	600362	江西铜业	7,634	180,773.12	0.13
216	002422	科伦药业	5,937	180,069.21	0.13
217	603195	公牛集团	2,320	178,918.40	0.13
218	002920	德赛西威	2,049	178,447.41	0.13
219	600161	天坛生物	7,280	177,632.00	0.13
220	300394	天孚通信	2,000	176,840.00	0.13
221	600196	复星医药	7,817	173,068.38	0.12
222	002460	赣锋锂业	5,996	171,785.40	0.12
223	300628	亿联网络	4,611	169,546.47	0.12

224	688009	中国通号	27,842	167,052.00	0.12
225	601058	赛轮轮胎	11,931	167,034.00	0.12
226	000975	山金国际	10,246	166,907.34	0.12
227	000933	神火股份	8,227	166,432.21	0.12
228	600018	上港集团	28,765	166,261.70	0.12
229	600985	淮北矿业	9,900	165,726.00	0.12
230	601238	广汽集团	21,396	165,605.04	0.12
231	000708	中信特钢	12,200	165,554.00	0.12
232	002049	紫光国微	3,147	165,532.20	0.12
233	300999	金龙鱼	6,023	164,729.05	0.12
234	600733	北汽蓝谷	20,300	164,024.00	0.12
235	600219	南山铝业	42,714	162,740.34	0.12
236	600398	海澜之家	17,600	162,624.00	0.12
237	601077	渝农商行	32,305	162,171.10	0.12
238	600176	中国巨石	14,655	161,937.75	0.12
239	002466	天齐锂业	5,400	161,514.00	0.11
240	002601	龙佰集团	8,686	161,299.02	0.11
241	605117	德业股份	2,164	160,871.76	0.11
242	600221	海航控股	157,700	160,854.00	0.11
243	600256	广汇能源	23,956	160,505.20	0.11
244	601377	兴业证券	31,481	159,293.86	0.11
245	600642	申能股份	17,900	158,057.00	0.11
246	600096	云天化	8,100	157,302.00	0.11
247	601168	西部矿业	8,700	156,165.00	0.11
248	601991	大唐发电	51,800	155,918.00	0.11
249	601179	中国西电	19,300	155,172.00	0.11
250	000066	中国长城	17,426	152,477.50	0.11
251	300782	卓胜微	1,961	152,448.14	0.11
252	601878	浙商证券	14,203	152,256.16	0.11
253	000783	长江证券	31,388	151,604.04	0.11
254	000876	新希望	16,568	151,431.52	0.11
255	600415	小商品城	20,018	148,533.56	0.11
256	000728	国元证券	24,245	146,924.70	0.10
257	600009	上海机场	4,549	146,705.25	0.10
258	603198	迎驾贡酒	2,540	146,050.00	0.10
259	000738	航发控制	7,270	145,908.90	0.10
260	300418	昆仑万维	4,500	145,080.00	0.10
261	688188	柏楚电子	784	144,687.20	0.10
262	600918	中泰证券	25,511	144,647.37	0.10
263	000027	深圳能源	19,781	144,401.30	0.10
264	002064	华峰化学	20,086	144,016.62	0.10
265	300413	芒果超媒	6,850	143,165.00	0.10
266	002078	太阳纸业	10,250	142,987.50	0.10

267	300661	圣邦股份	1,719	142,298.82	0.10
268	600487	亨通光电	9,018	142,213.86	0.10
269	603806	福斯特	9,673	142,193.10	0.10
270	000408	藏格矿业	5,900	142,013.00	0.10
271	601233	桐昆股份	8,834	140,990.64	0.10
272	002223	鱼跃医疗	3,721	139,909.60	0.10
273	603799	华友钴业	6,302	139,463.26	0.10
274	300316	晶盛机电	4,849	139,311.77	0.10
275	000723	美锦能源	29,233	139,149.08	0.10
276	002797	第一创业	27,333	139,124.97	0.10
277	000661	长春高新	1,514	138,939.78	0.10
278	688126	沪硅产业	10,057	138,887.17	0.10
279	300866	安克创新	1,950	138,859.50	0.10
280	002532	天山铝业	17,096	138,648.56	0.10
281	002202	金风科技	20,522	137,907.84	0.10
282	688599	天合光能	8,116	137,322.72	0.10
283	002625	光启技术	7,902	137,099.70	0.10
284	002180	纳思达	5,176	136,749.92	0.10
285	688303	大全能源	6,700	136,613.00	0.10
286	603260	合盛硅业	2,923	136,533.33	0.10
287	002459	晶澳科技	12,135	135,912.00	0.10
288	600061	国投资本	23,500	132,775.00	0.09
289	600348	华阳股份	13,261	132,079.56	0.09
290	002353	杰瑞股份	3,757	131,795.56	0.09
291	002050	三花智控	6,900	131,652.00	0.09
292	688072	拓荆科技	1,095	131,520.45	0.09
293	002384	东山精密	6,341	131,258.70	0.09
294	600515	海南机场	41,700	130,938.00	0.09
295	300765	新诺威	5,180	130,691.40	0.09
296	600177	雅戈尔	18,214	129,683.68	0.09
297	600745	闻泰科技	4,578	129,328.50	0.09
298	603568	伟明环保	6,272	129,077.76	0.09
299	000988	华工科技	4,300	128,699.00	0.09
300	603606	东方电缆	2,633	128,516.73	0.09
301	002129	TCL 中环	14,816	128,158.40	0.09
302	688187	时代电气	2,573	127,054.74	0.09
303	600418	江淮汽车	8,000	126,720.00	0.09
304	002602	世纪华通	36,867	126,453.81	0.09
305	002939	长城证券	18,863	126,382.10	0.09
306	002966	苏州银行	16,800	126,000.00	0.09
307	002074	国轩高科	6,542	125,279.30	0.09
308	600588	用友网络	12,455	124,550.00	0.09
309	300442	润泽科技	5,200	124,540.00	0.09

310	002156	通富微电	5,561	124,510.79	0.09
311	002709	天赐材料	7,090	124,500.40	0.09
312	601799	星宇股份	1,110	124,364.40	0.09
313	300751	迈为股份	1,033	123,422.84	0.09
314	002281	光迅科技	3,300	123,321.00	0.09
315	600570	恒生电子	6,980	123,266.80	0.09
316	301236	软通动力	3,500	123,235.00	0.09
317	601958	金钼股份	11,800	122,838.00	0.09
318	000513	丽珠集团	3,257	121,192.97	0.09
319	002444	巨星科技	4,900	121,030.00	0.09
320	002739	万达电影	10,000	120,900.00	0.09
321	601577	长沙银行	14,769	120,810.42	0.09
322	000937	冀中能源	17,984	120,492.80	0.09
323	000960	锡业股份	7,760	120,202.40	0.09
324	002340	格林美	18,796	119,730.52	0.09
325	600998	九州通	24,426	119,198.88	0.08
326	600060	海信视像	4,800	118,752.00	0.08
327	603156	养元饮品	5,500	116,985.00	0.08
328	600970	中材国际	9,700	116,982.00	0.08
329	603160	汇顶科技	1,700	116,875.00	0.08
330	000683	远兴能源	16,673	115,210.43	0.08
331	002812	恩捷股份	3,636	115,079.40	0.08
332	000709	河钢股份	59,230	114,906.20	0.08
333	002595	豪迈科技	3,000	114,510.00	0.08
334	688120	华海清科	600	113,748.00	0.08
335	601216	君正集团	30,825	113,744.25	0.08
336	601966	玲珑轮胎	6,159	113,140.83	0.08
337	601108	财通证券	17,080	112,898.80	0.08
338	600038	中直股份	2,727	112,106.97	0.08
339	600282	南钢股份	22,500	112,050.00	0.08
340	000932	华菱钢铁	25,268	111,937.24	0.08
341	603979	金诚信	2,200	111,166.00	0.08
342	603589	口子窖	2,831	110,946.89	0.08
343	603939	益丰药房	4,512	110,769.60	0.08
344	688777	中控技术	2,937	110,724.90	0.08
345	603659	璞泰来	7,829	110,623.77	0.08
346	603338	浙江鼎力	1,821	110,024.82	0.08
347	002294	信立泰	4,117	109,635.71	0.08
348	601231	环旭电子	6,800	109,140.00	0.08
349	603899	晨光股份	3,488	109,104.64	0.08
350	000729	燕京啤酒	12,300	108,609.00	0.08
351	600460	士兰微	6,197	108,509.47	0.08
352	600873	梅花生物	10,800	108,216.00	0.08



353	002409	雅克科技	1,716	107,953.56	0.08
354	600566	济川药业	3,400	107,814.00	0.08
355	300919	中伟股份	3,474	107,659.26	0.08
356	002831	裕同科技	4,200	107,478.00	0.08
357	601555	东吴证券	18,206	107,415.40	0.08
358	600546	山煤国际	7,300	106,726.00	0.08
359	002007	华兰生物	6,746	106,519.34	0.08
360	600132	重庆啤酒	1,750	106,225.00	0.08
361	600968	海油发展	25,700	105,884.00	0.08
362	002555	三七互娱	8,081	105,457.05	0.07
363	600895	张江高科	5,700	105,336.00	0.07
364	600380	健康元	9,424	105,266.08	0.07
365	601866	中远海发	40,559	104,642.22	0.07
366	300207	欣旺达	6,881	104,384.77	0.07
367	600582	天地科技	15,100	104,039.00	0.07
368	600079	人福医药	6,054	103,947.18	0.07
369	601990	南京证券	13,500	103,680.00	0.07
370	300003	乐普医疗	6,959	103,271.56	0.07
371	600021	上海电力	10,400	102,856.00	0.07
372	600109	国金证券	13,600	102,680.00	0.07
373	600352	浙江龙盛	11,900	102,221.00	0.07
374	002085	万丰奥威	7,700	101,948.00	0.07
375	601928	凤凰传媒	9,300	101,928.00	0.07
376	688363	华熙生物	1,800	101,826.00	0.07
377	603658	安图生物	2,200	101,354.00	0.07
378	600988	赤峰黄金	6,200	101,308.00	0.07
379	300759	康龙化成	5,449	101,242.42	0.07
380	002673	西部证券	16,312	100,971.28	0.07
381	601666	平煤股份	9,000	100,800.00	0.07
382	603486	科沃斯	2,126	100,304.68	0.07
383	301269	华大九天	1,300	100,165.00	0.07
384	000831	中国稀土	3,926	99,524.10	0.07
385	600497	驰宏锌锗	18,600	99,324.00	0.07
386	002032	苏泊尔	1,978	99,097.80	0.07
387	603833	欧派家居	1,850	99,086.00	0.07
388	603816	顾家家居	3,047	98,387.63	0.07
389	600153	建发股份	10,993	98,167.49	0.07
390	000800	一汽解放	12,484	97,749.72	0.07
391	300223	北京君正	1,740	96,465.60	0.07
392	688122	西部超导	2,506	96,029.92	0.07
393	600157	永泰能源	81,100	95,698.00	0.07
394	688728	格科微	7,900	95,669.00	0.07
395	600583	海油工程	16,181	95,629.71	0.07

396	002185	华天科技	11,732	95,615.80	0.07
397	000703	恒逸石化	13,469	95,495.21	0.07
398	688065	凯赛生物	2,100	95,319.00	0.07
399	600536	中国软件	3,180	95,145.60	0.07
400	002603	以岭药业	6,168	94,555.44	0.07
401	002152	广电运通	9,020	94,349.20	0.07
402	601880	辽港股份	76,300	93,849.00	0.07
403	601198	东兴证券	11,790	93,848.40	0.07
404	002465	海格通信	9,049	93,747.64	0.07
405	600704	物产中大	21,511	93,357.74	0.07
406	601696	中银证券	10,252	93,088.16	0.07
407	002456	欧菲光	11,900	92,939.00	0.07
408	002414	高德红外	15,644	92,143.16	0.07
409	600521	华海药业	5,396	92,001.80	0.07
410	688099	晶晨股份	1,541	91,412.12	0.06
411	002372	伟星新材	5,922	91,317.24	0.06
412	600298	安琪酵母	3,260	91,051.80	0.06
413	603596	伯特利	2,340	91,026.00	0.06
414	300251	光线传媒	10,738	90,306.58	0.06
415	600754	锦江酒店	3,929	90,288.42	0.06
416	002841	视源股份	3,040	89,771.20	0.06
417	002080	中材科技	6,901	89,022.90	0.06
418	603885	吉祥航空	8,100	89,019.00	0.06
419	600549	厦门钨业	5,156	88,941.00	0.06
420	603893	瑞芯微	1,500	88,755.00	0.06
421	002262	恩华药业	3,700	87,838.00	0.06
422	603529	爱玛科技	3,200	87,456.00	0.06
423	600369	西南证券	24,200	86,636.00	0.06
424	600511	国药股份	2,800	86,212.00	0.06
425	300146	汤臣倍健	6,299	85,351.45	0.06
426	600486	扬农化工	1,507	85,070.15	0.06
427	000629	钒钛股份	33,941	84,852.50	0.06
428	688082	盛美上海	1,000	84,510.00	0.06
429	601456	国联证券	8,737	84,224.68	0.06
430	688538	和辉光电	42,110	83,377.80	0.06
431	000733	振华科技	1,994	82,810.82	0.06
432	600004	白云机场	8,700	82,476.00	0.06
433	002821	凯莱英	1,250	82,250.00	0.06
434	300037	新宙邦	2,874	82,081.44	0.06
435	002120	韵达股份	10,602	82,059.48	0.06
436	603000	人民网	4,100	81,959.00	0.06
437	600166	福田汽车	36,300	81,675.00	0.06
438	000009	中国宝安	9,475	81,485.00	0.06

439	600598	北大荒	6,521	81,447.29	0.06
440	002430	杭氧股份	3,637	80,923.25	0.06
441	600378	昊华科技	2,800	80,920.00	0.06
442	600848	上海临港	8,739	79,612.29	0.06
443	603345	安井食品	1,061	78,842.91	0.06
444	300454	深信服	1,560	78,826.80	0.06
445	600673	东阳光	11,100	78,144.00	0.06
446	002508	老板电器	3,514	77,659.40	0.06
447	300496	中科创达	1,700	77,503.00	0.06
448	300144	宋城演艺	9,631	77,336.93	0.05
449	300699	光威复材	3,112	77,270.96	0.05
450	300487	蓝晓科技	1,850	77,256.00	0.05
451	300957	贝泰妮	1,596	77,118.72	0.05
452	600699	均胜电子	5,194	76,975.08	0.05
453	000987	越秀资本	15,339	76,081.44	0.05
454	688114	华大智造	1,600	75,856.00	0.05
455	002517	恺英网络	7,900	75,445.00	0.05
456	600839	四川长虹	16,800	75,432.00	0.05
457	002850	科达利	986	75,310.68	0.05
458	603290	斯达半导	872	75,087.92	0.05
459	002056	横店东磁	6,000	74,820.00	0.05
460	600637	东方明珠	12,300	74,784.00	0.05
461	600072	中船科技	5,500	74,360.00	0.05
462	600977	中国电影	6,900	74,244.00	0.05
463	600655	豫园股份	14,257	73,423.55	0.05
464	002738	中矿资源	2,703	72,440.40	0.05
465	600705	中航产融	32,325	71,761.50	0.05
466	000825	太钢不锈	20,922	70,716.36	0.05
467	600170	上海建工	32,470	69,810.50	0.05
468	002756	永兴材料	1,943	69,520.54	0.05
469	601162	天风证券	31,600	68,888.00	0.05
470	600702	舍得酒业	1,200	68,004.00	0.05
471	300142	沃森生物	5,956	67,779.28	0.05
472	600872	中炬高新	2,976	67,525.44	0.05
473	300347	泰格医药	1,387	67,408.20	0.05
474	600884	杉杉股份	8,276	67,201.12	0.05
475	600779	水井坊	1,768	66,529.84	0.05
476	600563	法拉电子	853	64,981.54	0.05
477	300601	康泰生物	4,156	64,875.16	0.05
478	300763	锦浪科技	1,473	61,335.72	0.04
479	600732	爱旭股份	6,720	60,816.00	0.04
480	603233	大参林	4,230	60,489.00	0.04
481	603728	鸣志电器	1,500	60,345.00	0.04

482	603688	石英股份	2,000	59,220.00	0.04
483	002271	东方雨虹	4,600	56,764.00	0.04
484	603077	和邦生物	32,330	53,344.50	0.04
485	603882	金域医学	1,672	45,461.68	0.03

### 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	603285	键邦股份	761	14,192.65	0.01
2	603381	永臻股份	64	1,608.32	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	000333	美的集团	896,028.00	0.58
2	000858	五粮液	493,374.00	0.32
3	000921	海信家电	351,253.00	0.23
4	000725	京东方 A	215,230.00	0.14
5	001965	招商公路	208,525.00	0.14
6	601398	工商银行	199,616.00	0.13
7	000708	中信特钢	183,702.00	0.12
8	688223	晶科能源	160,579.14	0.10
9	601567	三星医疗	158,916.00	0.10
10	601288	农业银行	141,520.00	0.09
11	601816	京沪高铁	137,119.00	0.09
12	000100	TCL 科技	136,549.00	0.09
13	000166	申万宏源	133,901.00	0.09
14	300750	宁德时代	124,480.00	0.08
15	600905	三峡能源	119,747.00	0.08
16	603979	金诚信	119,580.00	0.08
17	002085	万丰奥威	117,818.00	0.08
18	000938	紫光股份	117,668.00	0.08
19	601881	中国银河	113,899.00	0.07
20	601600	中国铝业	113,191.00	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	300750	宁德时代	468,842.00	0.30
2	000858	五粮液	277,086.00	0.18

3	002594	比亚迪	224,400.00	0.15
4	300760	迈瑞医疗	173,453.00	0.11
5	600519	贵州茅台	164,250.00	0.11
6	002714	牧原股份	133,945.00	0.09
7	002475	立讯精密	128,991.00	0.08
8	300059	东方财富	125,707.00	0.08
9	000568	泸州老窖	119,606.00	0.08
10	000001	平安银行	119,537.00	0.08
11	002352	顺丰控股	115,221.00	0.07
12	688032	禾迈股份	113,825.27	0.07
13	688301	奕瑞科技	108,273.31	0.07
14	002244	滨江集团	106,154.00	0.07
15	603737	三棵树	95,018.72	0.06
16	600900	长江电力	94,389.00	0.06
17	688516	奥特维	92,759.43	0.06
18	601933	永辉超市	91,700.00	0.06
19	002568	百润股份	91,668.66	0.06
20	002138	顺络电子	91,317.36	0.06

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	11,220,601.98
卖出股票收入（成交）总额	16,083,839.35

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

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活

跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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	118,261.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,410.15
8	其他	-
9	合计	193,671.99

### 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	占基金资产净	流通受限情况说
----	------	------	----------	--------	---------

			允价值	值比例 (%)	明
1	603285	键邦股份	14,192.65	0.01	新股流通受限
2	603381	永臻股份	1,608.32	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 (%)
1,545	78,191.32	77,303,475.00	63.99	43,502,107.00	36.01

### 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	国开金融有限责任公司	46,440,000.00	38.44
2	永安国富资产管理有限公司—永安国富—稳健6号私募基金	12,370,600.00	10.24
3	中信建投证券股份有限公司	9,911,658.00	8.20
4	广发证券股份有限公司	3,200,435.00	2.65
5	方正证券股份有限公司	2,585,709.00	2.14
6	陈燕	2,000,000.00	1.66
7	中信证券股份有限公司	1,605,522.00	1.33
8	王明华	1,350,000.00	1.12
9	于忠宝	1,000,000.00	0.83
9	赵汝佳	1,000,000.00	0.83

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（2019 年 3 月 19 日） 基金份额总额	2,058,805,582.00
本报告期期初基金份额总额	132,805,582.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	15,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,805,582.00

## § 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 (%)	
国泰君安	3	10,902,784.39	39.97	3,767.35	40.87	-
兴业证券	1	9,839,664.74	36.08	3,403.77	36.93	-
长江证券	2	6,533,019.00	23.95	2,045.68	22.20	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	7	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	新增2个交易单元
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	2	-	-	-	-	-

国际证券						
英大证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	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等。

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证	-	-	-	-	-	-

券						
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-

招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-

### 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 MSCI 中国 A 股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
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
4	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 5 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 19 日
6	《银华 MSCI 中国 A 股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
7	《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
8	《银华 MSCI 中国 A 股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
9	《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
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加中泰证券股份有限公司为旗下银华	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2024 年 5 月 23 日

	MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券商的公告》	网站, 证券时报	
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 5 月 29 日
12	《银华 MSCI 中国 A 股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
13	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 6 月 28 日

## § 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	20240101-20240630	46,440,000.00	0.00	0.00	46,440,000.00	38.44

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时, 将面临本基金的特定风险, 具体包括:

- 1) 当基金份额集中度较高时, 少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高, 其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权;
- 2) 在极端情况下, 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元, 进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金, 其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会;
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 更容易触发巨额赎回条款, 基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券, 可能造成证券价格波动, 导致本基金的收益水平发生波动。同时, 巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提, 会导致基金份额净值出现大幅波动;
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时, 本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下, 该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%, 该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华MSCI中国A股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MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024年8月31日