

银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数 证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 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	65
8.7 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	65
8.8 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	66
8.9 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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4 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	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
11.2 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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000 增强 ETF
场内简称	1000 增强 ETF
基金主代码	159677
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 24 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,904,091.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 12 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强投资策略，主要包括（1）指数化投资策略：本基金指数化投资以标的指数的成份股组成及其权重为基础，确定本基金投资组合的基本构成和大致权重，并通过控制投资组合中个股权重对标的指数成份股权重的偏离，实现对标的指数的跟踪和对跟踪误差的控制。（2）量化增强投资策略：本基金将在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整，以争取实现指数增强的目标。</p> <p>本基金标的指数为中证 1000 指数。建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，采用指数增强投资策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	银华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨文辉	王小飞
	联系电话	(010) 58163000	021-60637103
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	021-60637228
传真		(010) 58163027	021-60635778
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王珠林	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年	2022 年 11 月 24 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	8,051,445.93	13,133,338.96	13,110,337.70
本期利润	9,790,401.38	18,500,938.57	5,418,712.70
加权平均基金份额本期利润	0.1096	0.1184	0.0090
本期加权平均净值利润率	12.33%	11.58%	0.90%
本期基金份额净值增长率	4.21%	0.96%	-3.42%
3.1.2 期	2024 年末	2023 年末	2022 年末

末数据和指标			
期末可供分配利润	826,080.66	-2,165,343.74	-8,833,206.94
期末可供分配基金份额利润	0.0162	-0.0249	-0.0342
期末基金资产净值	51,730,171.66	84,738,747.26	249,070,884.06
期末基金份额净值	1.0162	0.9751	0.9658
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	1.62%	-2.49%	-3.42%

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。

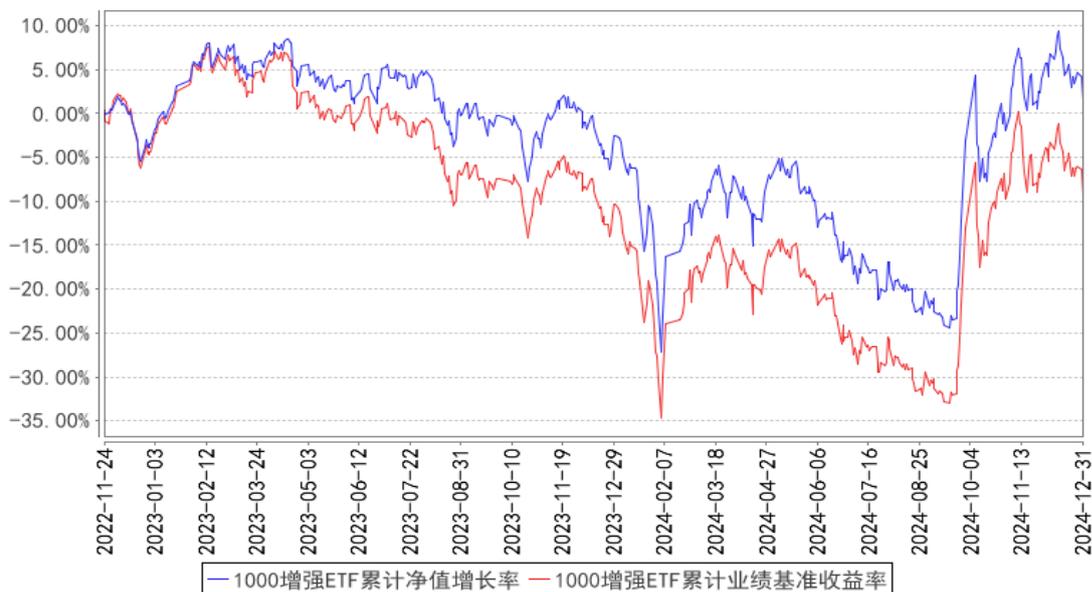
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	4.94%	2.12%	4.36%	2.40%	0.58%	-0.28%
过去六个月	21.12%	2.06%	21.69%	2.24%	-0.57%	-0.18%
过去一年	4.21%	1.97%	1.20%	2.12%	3.01%	-0.15%
自基金合同生效起至今	1.62%	1.49%	-9.29%	1.61%	10.91%	-0.12%

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

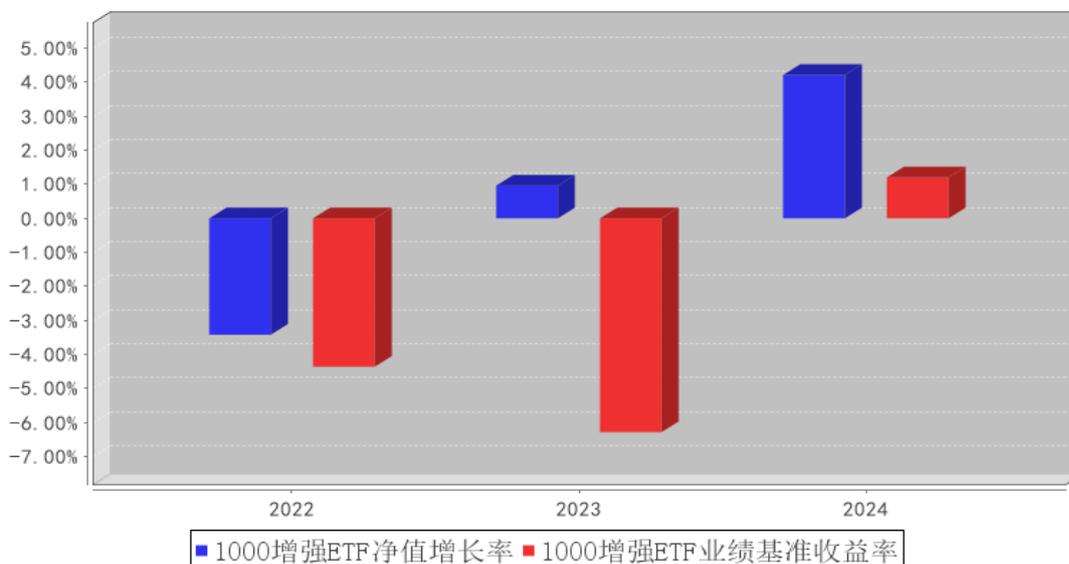
1000增强ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1000增强ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日止会计期间、2023年度及2024年度未进行利润分配。

§ 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

银华基金管理股份有限公司成立于2001年5月，注册资本2.222亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至2024年末，银华基金管理公募基金217只，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII基金、混合型基金、债券型基金及货币市场基金等各类产品，拥有完善的产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自2020年起连续四年实现经营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2022年11月24日	-	15.5年	硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自2012年11月14日至2020年11月25日担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2013年11月5日至2019年9月26日兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自

				<p>2016年4月7日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年4月25日至2018年11月30日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2020年11月29日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理，自2019年6月28日至2021年7月23日兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年8月29日至2020年12月31日兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2019年12月6日至2021年9月17日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年11月26日至2022年7月28日兼任银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2020年11月30日起兼任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年1月1日起兼任银华深证100指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年2月3日至2022年2月23日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年5月13日至2022年6月17日兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年7月29日至2023年7月28日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月22日至2023年7月28日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月28日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2021年11月19日起兼任银华中证ESG领先指数证券投资基金基金经理，自2021年12月20日至2023年7月28日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年1月27日至2023年7月28日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年3月7日至2023年9月8日兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金</p>
--	--	--	--	---

					基金经理,自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
王帅先生	本基金的基金经理	2022 年 11 月 24 日	2024 年 1 月 23 日	12.5 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

				<p>经理，自 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日至 2023 年 4 月 6 日兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 7 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 30 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 18 日至 2023 年 3 月 17 日兼任银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 30 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 1 日起兼任银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 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，自 2025 年 1 月 17 日起兼任银华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 17 日至 2025 年 2 月 4 日兼任银华上证 180 指数型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 5 日起兼任银</p>
--	--	--	--	--

					华上证 180 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。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2022 年 11 月 24 日	-	11 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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四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。

4.3.3 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 7 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，国内外的宏观经济运行都呈现出一些新的特点。国内方面，经济主基调是在新旧转换的过程中寻求质与量的平衡点。分经济部门来看，居民消费领域仍然延续了此前的复苏趋势，而商务活动的复苏进程仍然较弱。这样的消费结构使消费领域呈现年节化、家庭化、中低价位段的特征。此外，宏观政策在诸多方面提升了支持力度，包括地产、化债、消费补贴、资本市场支持等。国外方面，美联储三次下调联邦基金利率，正式进入降息周期；而另一方面，伴随美国政府的换届，其货币、财政、关税政策仍存在预期不明朗之处。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在 2024 年明显反弹。

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 1.0162 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.21%，业绩比较基准收益率为 1.20%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 6.5% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，宏观政策对经济的支撑作用有望逐步显现。从更远的视角来看，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。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；而随着新旧更替的深入，经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期，国内政策、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，根据法律法规、监管规定和业务发展的需要，持续健全合规管理及监察稽核机制，改进合规管理方式，提高合规管理能力，推进合规文化建设，提升合规管理工作的有效性。

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实基于风险的反洗钱理念，健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处理事务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]100Z0904号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“1000 增强 ETF”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了 1000 增强 ETF2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

	<p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于 1000 增强 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>1000 增强 ETF 的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估 1000 增强 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算 1000 增强 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督 1000 增强 ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对 1000 增强 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。</p>

	然而,未来的事项或情况可能导致 1000 增强 ETF 不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 陈玉珊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	2,847,529.31	1,803,080.73
结算备付金		1,694,197.01	469,578.46
存出保证金		450,595.52	121,201.22
交易性金融资产	7.4.7.2	46,986,640.19	82,736,659.53
其中: 股票投资		46,986,640.19	82,736,659.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
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	7.4.7.8	-	-
资产总计		51,978,962.03	85,130,519.94
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20.87	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,756.26	36,425.99
应付托管费		4,551.26	7,285.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	221,461.98	348,061.48
负债合计		248,790.37	391,772.68
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	50,904,091.00	86,904,091.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	826,080.66	-2,165,343.74
净资产合计		51,730,171.66	84,738,747.26
负债和净资产总计		51,978,962.03	85,130,519.94

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0162 元，基金份额总额 50,904,091.00 份。

7.2 利润表

会计主体：银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
一、营业总收入		10,439,087.60	19,662,219.07
1. 利息收入		45,226.53	55,533.94
其中：存款利息收入	7.4.7.13	45,226.53	55,533.94
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）		9,041,562.04	12,678,807.16
其中：股票投资收益	7.4.7.14	6,986,572.45	10,432,751.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	853,456.02	-
股利收益	7.4.7.19	1,201,533.57	2,246,055.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	1,738,955.45	5,367,599.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-386,656.42	1,560,278.36
减：二、营业总支出		648,686.22	1,161,280.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	403,777.47	803,442.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,755.51	160,688.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,891.23	-
8. 其他费用	7.4.7.23	160,262.01	197,149.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,790,401.38	18,500,938.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,790,401.38	18,500,938.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,790,401.38	18,500,938.57

7.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,000,000.00	-	2,991,424.40	-33,008,575.60
（一）、综合收益总额	-	-	9,790,401.38	9,790,401.38
（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）	-36,000,000.00	-	-6,798,976.98	-42,798,976.98
其中：1. 基金申购款	240,000,000.00	-	-31,247,115.17	208,752,884.83
2. 基金赎回款	-276,000,000.00	-	24,448,138.19	-251,551,861.81
（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	50,904,091.00	-	826,080.66	51,730,171.66
项目	上年度可比期间			

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-171,000,000.00	-	6,667,863.20	-164,332,136.80
(一)、综合收益总额	-	-	18,500,938.57	18,500,938.57
(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)	-171,000,000.00	-	-11,833,075.37	-182,833,075.37
其中：1. 基金申购款	822,000,000.00	-	21,990,550.48	843,990,550.48
2. 基金赎回款	-993,000,000.00	-	-33,823,625.85	-1,026,823,625.85
(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	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2601 号《关于准予银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,250,861,344.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0951 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,250,904,091.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 42,747.00 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]1122 号核准,本基金 1,250,904,091.00 份基金份额于 2022 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为:

中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于 2025 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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》、《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基

金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证

券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,847,529.31	1,803,080.73
等于：本金	2,847,226.52	1,802,827.87
加：应计利息	302.79	252.86
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	2,847,529.31	1,803,080.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		47,471,670.13	-	46,986,640.19	-485,029.94
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		47,471,670.13	-	46,986,640.19	-485,029.94
项目	上年度末 2023年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		85,060,684.92	-	82,736,659.53	-2,324,025.39
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		85,060,684.92	-	82,736,659.53	-2,324,025.39

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,658,640.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,658,640.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	3,658,640.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2501	IM2501	2.00	2,382,320.00	-67,400.00
IM2503	IM2503	1.00	1,176,280.00	-32,640.00
合计				-100,040.00
减：可抵销期货 暂收款				-100,040.00
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 12 月 31 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。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024年12月31日	2023年12月31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	41,461.98	153,061.48
其中：交易所市场	41,461.98	153,061.48
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	195,000.00
合计	221,461.98	348,061.48

7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	86,904,091.00	86,904,091.00
本期申购	240,000,000.00	240,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-276,000,000.00	-276,000,000.00
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	50,904,091.00	50,904,091.00

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,476,601.91	-7,641,945.65	-2,165,343.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,476,601.91	-7,641,945.65	-2,165,343.74
本期利润	8,051,445.93	1,738,955.45	9,790,401.38
本期基金份额交易产生的变动数	-3,619,088.52	-3,179,888.46	-6,798,976.98
其中：基金申购款	2,391,972.84	-33,639,088.01	-31,247,115.17
	-6,011,061.36	30,459,199.55	24,448,138.19

金赎回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,908,959.32	-9,082,878.66	826,080.66

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	13,687.76	22,052.13
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	31,098.03	29,711.51
其他	440.74	3,770.30
合计	45,226.53	55,533.94

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,683,936.30	9,130,000.17
股票投资收益——赎回差价收入	1,302,636.15	1,302,751.62
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	6,986,572.45	10,432,751.79

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总	657,106,686.83	1,424,982,058.45

额		
减：卖出股票成本总额	650,666,257.92	1,412,974,761.38
减：交易费用	756,492.61	2,877,296.90
买卖股票差价收入	5,683,936.30	9,130,000.17

7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	251,551,861.81	1,026,823,625.85
减：现金支付赎回款总额	131,528,617.81	498,293,710.85
减：赎回股票成本总额	118,720,607.85	527,227,163.38
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,302,636.15	1,302,751.62

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	853,456.02	-

7.4.7.19 股利收益

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12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,201,533.57	2,246,055.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	1,201,533.57	2,246,055.37
----	--------------	--------------

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,838,995.45	5,367,599.61
股票投资	1,838,995.45	5,367,599.61
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	-100,040.00	-
权证投资	-	-
期货投资	-100,040.00	-
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	1,738,955.45	5,367,599.61

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-386,656.42	1,560,278.36
合计	-386,656.42	1,560,278.36

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	20,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	260.00	270.00
其他	20,002.01	21,879.45
合计	160,262.01	197,149.45

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
西南证券	127,480,299.56	9.88	831,377,450.16	29.79

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年12月12日（基金合同生效日）至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	42,471.09	12.31	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
西南证券	364,985.21	26.09	10,597.99	6.92

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年12月12日（基金合同 生效日）至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	403,777.47
其中：应支付销售机构的客户维护 费	32,431.05	58,778.94
应支付基金管理人的净管理费	371,346.42	744,663.63

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人

无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	80,755.51	160,688.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,847,529.31	13,687.76	1,803,080.73	22,052.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	2,847,529.31	-	-	-	2,847,529.31
结算备付金	1,694,197.01	-	-	-	1,694,197.01
存出保证金	450,595.52	-	-	-	450,595.52
交易性金融资产	-	-	-	46,986,640.19	46,986,640.19
资产总计	4,992,321.84	-	-	46,986,640.19	51,978,962.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,756.26	22,756.26
应付托管费	-	-	-	4,551.26	4,551.26
应付清算款	-	-	-	20.87	20.87
其他负债	-	-	-	221,461.98	221,461.98
负债总计	-	-	-	248,790.37	248,790.37
利率敏感度缺口	4,992,321.84	-	-	46,737,849.82	51,730,171.66
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,803,080.73	-	-	-	1,803,080.73
结算备付金	469,578.46	-	-	-	469,578.46
存出保证金	121,201.22	-	-	-	121,201.22
交易性金融资产	-	-	-	82,736,659.53	82,736,659.53
资产总计	2,393,860.41	-	-	82,736,659.53	85,130,519.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,425.99	36,425.99
应付托管费	-	-	-	7,285.21	7,285.21
其他负债	-	-	-	348,061.48	348,061.48

负债总计	-	-	391,772.68	391,772.68
利率敏感度缺口	2,393,860.41	-	82,344,886.85	84,738,747.26

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的利率敏感性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。

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例(%)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
交易性金融资产—股票投资	46,986,640.19	90.83	82,736,659.53	97.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	46,986,640.19	90.83	82,736,659.53	97.64
----	---------------	-------	---------------	-------

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,381,164.74	3,805,662.67
	业绩比较基准下降 5%	-2,381,164.74	-3,805,662.67

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	46,986,640.19	82,407,742.09
第二层次	-	56,086.52
第三层次	-	272,830.92

合计	46,986,640.19	82,736,659.53
----	---------------	---------------

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	272,830.92	272,830.92
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	208,824.93	208,824.93
当期利得或损失总额	-	-64,005.99	-64,005.99
其中：计入损益的利得或损失	-	-64,005.99	-64,005.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	239,365.40	239,365.40
转出第三层次	-	2,209.62	2,209.62
当期利得或损失总额	-	35,675.14	35,675.14
其中：计入损益的利得或损失	-	35,675.14	35,675.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	272,830.92	272,830.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,838.52	35,838.52

注：于本报告期，本基金购买第三层次交易性金融资产及第三层次转入/转出的交易性金融资产均为限售股票投资及限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	272,830.92	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	46,986,640.19	90.40
	其中：股票	46,986,640.19	90.40
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	4,541,726.32	8.74
8	其他各项资产	450,595.52	0.87
9	合计	51,978,962.03	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	134,790.00	0.26
B	采矿业	460,610.00	0.89
C	制造业	28,323,999.94	54.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,214,395.20	2.35
E	建筑业	1,045,507.00	2.02
F	批发和零售业	1,490,000.50	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	2,296,844.00	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,202,662.87	8.12
J	金融业	862,832.94	1.67
K	房地产业	637,762.00	1.23
L	租赁和商务服务	875,897.00	1.69

	业		
M	科学研究和技术服务业	480,281.08	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	406,566.60	0.79
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	657,233.00	1.27
S	综合	-	-
	合计	43,089,382.13	83.30

8.2.2 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	275,840.00	0.53
C	制造业	2,462,195.11	4.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,783.40	0.11
E	建筑业	166,882.00	0.32
F	批发和零售业	31,545.00	0.06
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	605,146.64	1.17
J	金融业	93,581.00	0.18
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	42,079.75	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	49,451.16	0.10
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	112,754.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	3,897,258.06	7.53

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	600037	歌华有线	43,500	324,510.00	0.63
2	000061	农产品	44,700	313,347.00	0.61
3	688088	虹软科技	8,126	313,338.56	0.61
4	300638	广和通	15,500	312,325.00	0.60
5	601311	骆驼股份	37,400	310,046.00	0.60
6	688100	威胜信息	8,448	305,817.60	0.59
7	600017	日照港	93,400	298,880.00	0.58
8	000035	中国天楹	61,300	298,531.00	0.58
9	300323	华灿光电	35,300	292,284.00	0.57
10	002249	大洋电机	49,400	289,978.00	0.56
11	002191	劲嘉股份	68,200	286,440.00	0.55
12	600623	华谊集团	40,500	283,500.00	0.55
13	000030	富奥股份	55,200	283,176.00	0.55
14	601811	新华文轩	17,800	282,130.00	0.55
15	002745	木林森	32,000	279,040.00	0.54
16	600675	中华企业	94,600	265,826.00	0.51
17	002859	洁美科技	12,700	263,525.00	0.51
18	300151	昌红科技	15,100	256,700.00	0.50
19	301217	铜冠铜箔	23,100	255,948.00	0.49
20	688128	中国电研	12,170	255,691.70	0.49
21	600662	外服控股	50,300	255,021.00	0.49
22	603989	艾华集团	16,900	254,852.00	0.49
23	002726	龙大美食	31,700	251,064.00	0.49
24	600456	宝钛股份	8,800	250,360.00	0.48
25	603881	数据港	11,000	249,150.00	0.48
26	688235	百济神州	1,533	246,843.66	0.48
27	601777	千里科技	32,100	245,565.00	0.47
28	600330	天通股份	34,100	242,110.00	0.47
29	000927	中国铁物	90,900	239,067.00	0.46
30	601963	重庆银行	25,600	237,568.00	0.46
31	688321	微芯生物	12,696	235,891.68	0.46
32	688315	诺禾致源	18,752	234,400.00	0.45
33	300627	华测导航	5,600	234,080.00	0.45
34	002928	华夏航空	29,800	231,248.00	0.45
35	603983	丸美生物	7,100	229,046.00	0.44
36	688586	江航装备	23,159	221,631.63	0.43

37	600531	豫光金铅	34,500	221,490.00	0.43
38	600718	东软集团	20,300	218,631.00	0.42
39	600063	皖维高新	53,400	213,600.00	0.41
40	603299	苏盐井神	18,700	208,318.00	0.40
41	601068	中铝国际	47,200	208,152.00	0.40
42	601515	东峰集团	51,700	205,766.00	0.40
43	600073	光明肉业	29,600	205,424.00	0.40
44	600575	淮河能源	51,200	203,264.00	0.39
45	300685	艾德生物	8,900	202,920.00	0.39
46	600305	恒顺醋业	25,400	202,692.00	0.39
47	603609	禾丰股份	23,500	202,570.00	0.39
48	688327	云从科技	16,693	201,985.30	0.39
49	601718	际华集团	70,600	200,504.00	0.39
50	300036	超图软件	11,800	200,364.00	0.39
51	688266	泽璟制药	3,171	197,585.01	0.38
52	600648	外高桥	16,500	196,515.00	0.38
53	002583	海能达	13,800	196,098.00	0.38
54	688048	长光华芯	4,992	194,638.08	0.38
55	000528	柳工	16,000	192,960.00	0.37
56	600320	振华重工	49,100	192,472.00	0.37
57	603699	纽威股份	8,600	190,662.00	0.37
58	002063	远光软件	32,920	189,619.20	0.37
59	300737	科顺股份	37,400	189,618.00	0.37
60	002265	建设工业	8,100	188,487.00	0.36
61	002267	陕天然气	22,200	187,590.00	0.36
62	600717	天津港	38,500	187,495.00	0.36
63	300869	康泰医学	13,400	186,796.00	0.36
64	300821	东岳硅材	23,800	184,688.00	0.36
65	300393	中来股份	29,400	183,750.00	0.36
66	000685	中山公用	19,700	181,831.00	0.35
67	600409	三友化工	33,400	180,360.00	0.35
68	600602	云赛智联	11,200	177,184.00	0.34
69	688106	金宏气体	10,319	175,526.19	0.34
70	601326	秦港股份	52,200	174,870.00	0.34
71	002053	云南能投	15,300	174,420.00	0.34
72	601333	广深铁路	50,700	173,901.00	0.34
73	000059	华锦股份	36,200	173,398.00	0.34
74	688127	蓝特光学	6,374	172,735.40	0.33
75	600507	方大特钢	42,500	172,125.00	0.33
76	002698	博实股份	10,000	170,000.00	0.33
77	600986	浙文互联	27,900	166,842.00	0.32
78	002099	海翔药业	32,000	165,120.00	0.32
79	688352	硕中科技	13,584	164,773.92	0.32

80	002390	信邦制药	36,000	163,800.00	0.32
81	600420	国药现代	13,700	163,578.00	0.32
82	300741	华宝股份	9,400	163,466.00	0.32
83	688389	普门科技	10,975	163,417.75	0.32
84	688232	新点软件	5,582	161,822.18	0.31
85	601678	滨化股份	42,200	158,672.00	0.31
86	600269	赣粤高速	28,200	158,202.00	0.31
87	601975	招商南油	49,900	156,187.00	0.30
88	688279	峰昭科技	985	155,334.50	0.30
89	688432	有研硅	13,711	154,934.30	0.30
90	603328	依顿电子	15,500	152,830.00	0.30
91	688336	三生国健	7,116	152,424.72	0.29
92	603997	继峰股份	13,200	151,140.00	0.29
93	002807	江阴银行	34,600	150,510.00	0.29
94	000019	深粮控股	22,900	150,453.00	0.29
95	002233	塔牌集团	19,600	150,332.00	0.29
96	603638	艾迪精密	8,900	150,321.00	0.29
97	002004	华邦健康	33,200	150,064.00	0.29
98	000088	盐田港	29,900	145,613.00	0.28
99	300770	新媒股份	3,600	145,476.00	0.28
100	301087	可孚医疗	4,100	144,976.00	0.28
101	002550	千红制药	23,300	144,460.00	0.28
102	003006	百亚股份	6,000	143,940.00	0.28
103	600740	山西焦化	35,400	142,662.00	0.28
104	688388	嘉元科技	9,684	142,645.32	0.28
105	603055	台华新材	12,800	141,824.00	0.27
106	002906	华阳集团	4,600	141,450.00	0.27
107	300593	新雷能	12,600	141,120.00	0.27
108	002091	江苏国泰	19,100	139,812.00	0.27
109	002034	旺能环境	9,000	139,500.00	0.27
110	600874	创业环保	23,300	139,101.00	0.27
111	300415	伊之密	6,900	138,414.00	0.27
112	000917	电广传媒	19,400	137,158.00	0.27
113	002498	汉缆股份	39,900	135,261.00	0.26
114	300455	航天智装	10,200	132,192.00	0.26
115	688146	中船特气	4,539	131,812.56	0.25
116	603281	江瀚新材	5,400	131,760.00	0.25
117	600477	杭萧钢构	51,200	131,584.00	0.25
118	002489	浙江永强	40,500	131,220.00	0.25
119	688531	日联科技	2,749	130,934.87	0.25
120	603267	鸿远电子	3,600	130,428.00	0.25
121	000968	蓝焰控股	19,600	130,340.00	0.25
122	603566	普莱柯	10,200	130,152.00	0.25

123	002446	盛路通信	19,800	129,690.00	0.25
124	688007	光峰科技	8,585	126,972.15	0.25
125	300702	天宇股份	7,600	126,616.00	0.24
126	002585	双星新材	23,500	125,490.00	0.24
127	601702	华峰铝业	6,800	124,576.00	0.24
128	002396	星网锐捷	6,400	121,536.00	0.23
129	688206	概伦电子	6,404	121,099.64	0.23
130	600929	雪天盐业	21,500	120,185.00	0.23
131	300482	万孚生物	5,300	118,773.00	0.23
132	600100	同方股份	16,700	118,737.00	0.23
133	002461	珠江啤酒	11,900	117,691.00	0.23
134	002705	新宝股份	7,800	117,000.00	0.23
135	688018	乐鑫科技	532	115,976.00	0.22
136	600223	福瑞达	15,300	115,668.00	0.22
137	002214	大立科技	10,300	114,845.00	0.22
138	002275	桂林三金	7,600	114,684.00	0.22
139	605333	沪光股份	3,500	114,205.00	0.22
140	300672	国科微	1,700	113,475.00	0.22
141	601519	大智慧	12,100	111,925.00	0.22
142	301262	海看股份	4,500	111,915.00	0.22
143	002773	康弘药业	5,700	111,720.00	0.22
144	600750	江中药业	4,900	111,230.00	0.22
145	603132	金徽股份	9,900	111,177.00	0.21
146	600780	通宝能源	19,700	110,911.00	0.21
147	000090	天健集团	26,900	110,559.00	0.21
148	601279	英利汽车	28,800	110,304.00	0.21
149	002948	青岛银行	28,200	109,416.00	0.21
150	600422	昆药集团	6,900	109,365.00	0.21
151	601619	嘉泽新能	32,800	108,896.00	0.21
152	600248	陕建股份	24,300	108,864.00	0.21
153	002697	红旗连锁	18,400	108,744.00	0.21
154	000761	本钢板材	33,700	107,840.00	0.21
155	002434	万里扬	17,300	107,260.00	0.21
156	688141	杰华特	3,499	107,104.39	0.21
157	601369	陕鼓动力	12,200	106,140.00	0.21
158	000498	山东路桥	17,800	105,910.00	0.20
159	000029	深深房 A	7,000	105,420.00	0.20
160	600810	神马股份	12,800	103,552.00	0.20
161	301039	中集车辆	11,400	103,170.00	0.20
162	603612	索通发展	7,600	102,676.00	0.20
163	000828	东莞控股	9,500	101,555.00	0.20
164	600403	大有能源	34,500	101,430.00	0.20
165	601222	林洋能源	14,300	101,101.00	0.20

166	601921	浙版传媒	12,800	100,864.00	0.19
167	300458	全志科技	2,600	100,776.00	0.19
168	603693	江苏新能	10,200	100,470.00	0.19
169	300768	迪普科技	5,700	99,750.00	0.19
170	600158	中体产业	12,000	99,240.00	0.19
171	300773	拉卡拉	5,600	99,120.00	0.19
172	600125	铁龙物流	16,700	99,031.00	0.19
173	300232	洲明科技	14,400	98,928.00	0.19
174	000766	通化金马	6,300	98,910.00	0.19
175	002100	天康生物	15,000	98,250.00	0.19
176	002061	浙江交科	24,000	97,920.00	0.19
177	000429	粤高速 A	6,600	97,020.00	0.19
178	000950	重药控股	18,000	96,840.00	0.19
179	600601	方正科技	22,000	96,580.00	0.19
180	600667	太极实业	13,900	96,188.00	0.19
181	688526	科前生物	6,702	95,771.58	0.19
182	000848	承德露露	10,500	94,185.00	0.18
183	000567	海德股份	13,718	93,693.94	0.18
184	600502	安徽建工	19,600	93,688.00	0.18
185	603025	大豪科技	6,100	93,025.00	0.18
186	600012	皖通高速	5,200	91,780.00	0.18
187	688208	道通科技	2,341	91,673.56	0.18
188	603530	神马电力	3,700	91,427.00	0.18
189	002534	西子洁能	8,100	89,991.00	0.17
190	603169	兰石重装	16,500	89,925.00	0.17
191	301180	万祥科技	5,800	89,726.00	0.17
192	600996	贵广网络	10,300	88,065.00	0.17
193	000517	荣安地产	39,400	87,862.00	0.17
194	000913	钱江摩托	4,800	86,448.00	0.17
195	002182	宝武镁业	7,600	85,728.00	0.17
196	603075	热威股份	4,600	85,698.00	0.17
197	000719	中原传媒	7,500	85,200.00	0.16
198	002567	唐人神	16,500	84,150.00	0.16
199	600882	妙可蓝多	4,700	84,130.00	0.16
200	688383	新益昌	1,870	83,906.90	0.16
201	601869	长飞光纤	2,800	83,692.00	0.16
202	000869	张裕 A	3,600	83,484.00	0.16
203	600006	东风股份	11,300	83,281.00	0.16
204	002747	埃斯顿	4,500	83,250.00	0.16
205	000012	南玻 A	15,600	82,368.00	0.16
206	000550	江铃汽车	3,500	82,075.00	0.16
207	002139	拓邦股份	6,000	81,660.00	0.16
208	688105	诺唯赞	3,662	81,186.54	0.16

209	000650	仁和药业	14,000	80,640.00	0.16
210	002226	江南化工	14,800	80,216.00	0.16
211	300432	富临精工	5,200	79,976.00	0.15
212	601886	江河集团	14,800	79,920.00	0.15
213	603043	广州酒家	4,800	79,824.00	0.15
214	600273	嘉化能源	10,000	79,700.00	0.15
215	688177	百奥泰	4,099	79,438.62	0.15
216	603229	奥翔药业	7,828	78,201.72	0.15
217	002405	四维图新	8,100	78,084.00	0.15
218	002174	游族网络	8,200	76,670.00	0.15
219	688700	东威科技	2,587	76,213.02	0.15
220	605599	菜百股份	6,700	76,045.00	0.15
221	002060	广东建工	20,700	75,762.00	0.15
222	600285	羚锐制药	3,400	75,344.00	0.15
223	000065	北方国际	7,700	75,306.00	0.15
224	300723	一品红	4,400	75,064.00	0.15
225	600869	远东股份	15,800	75,050.00	0.15
226	603093	南华期货	6,300	74,970.00	0.14
227	688185	康希诺	1,213	74,053.65	0.14
228	605365	立达信	4,700	73,790.00	0.14
229	301559	中集环科	4,800	73,680.00	0.14
230	688001	华兴源创	2,664	72,194.40	0.14
231	000600	建投能源	12,700	71,882.00	0.14
232	600328	中盐化工	9,100	71,617.00	0.14
233	300772	运达股份	5,400	71,496.00	0.14
234	603888	新华网	3,200	71,488.00	0.14
235	300180	华峰超纤	11,300	71,190.00	0.14
236	600335	国机汽车	11,300	70,399.00	0.14
237	688209	英集芯	3,974	70,220.58	0.14
238	688798	艾为电子	1,003	70,029.46	0.14
239	600916	中国黄金	8,100	69,822.00	0.13
240	301327	华宝新能	900	69,039.00	0.13
241	300284	苏交科	6,800	69,020.00	0.13
242	002081	金螳螂	19,200	68,544.00	0.13
243	300366	创意信息	7,300	67,890.00	0.13
244	300633	开立医疗	2,300	67,597.00	0.13
245	300188	国投智能	4,900	67,571.00	0.13
246	600059	古越龙山	7,600	67,488.00	0.13
247	600055	万东医疗	4,400	66,440.00	0.13
248	688147	微导纳米	2,392	64,320.88	0.12
249	301205	联特科技	800	60,552.00	0.12
250	300257	开山股份	6,600	60,192.00	0.12
251	300183	东软载波	3,100	59,985.00	0.12

252	300113	顺网科技	3,500	58,835.00	0.11
253	688598	金博股份	2,772	58,378.32	0.11
254	002096	易普力	4,900	58,212.00	0.11
255	600618	氯碱化工	5,800	57,188.00	0.11
256	300446	航天智造	3,400	56,134.00	0.11
257	600640	国脉文化	4,700	56,118.00	0.11
258	601890	亚星锚链	7,200	56,088.00	0.11
259	301339	通行宝	2,700	54,918.00	0.11
260	300596	利安隆	1,800	54,900.00	0.11
261	002276	万马股份	6,400	54,144.00	0.10
262	300346	南大光电	1,400	54,026.00	0.10
263	600266	城建发展	10,500	53,550.00	0.10
264	600201	生物股份	7,700	52,822.00	0.10
265	002545	东方铁塔	7,500	52,725.00	0.10
266	000860	顺鑫农业	2,700	52,569.00	0.10
267	002204	大连重工	10,400	51,792.00	0.10
268	688439	振华风光	990	50,777.10	0.10
269	600586	金晶科技	9,000	50,580.00	0.10
270	002274	华昌化工	6,500	50,505.00	0.10
271	600782	新钢股份	15,000	50,100.00	0.10
272	003012	东鹏控股	7,500	49,575.00	0.10
273	001270	铖昌科技	1,300	49,530.00	0.10
274	605376	博迁新材	1,700	49,215.00	0.10
275	300470	中密控股	1,300	49,010.00	0.09
276	600210	紫江企业	7,400	48,914.00	0.09
277	002258	利尔化学	5,900	48,793.00	0.09
278	603730	岱美股份	5,400	48,546.00	0.09
279	603027	千禾味业	4,000	48,440.00	0.09
280	300910	瑞丰新材	1,000	47,590.00	0.09
281	002088	鲁阳节能	3,700	47,323.00	0.09
282	600572	康恩贝	10,000	46,600.00	0.09
283	603308	应流股份	3,300	46,530.00	0.09
284	002891	中宠股份	1,300	46,410.00	0.09
285	002651	利君股份	6,300	46,179.00	0.09
286	603477	巨星农牧	2,600	46,150.00	0.09
287	002960	青鸟消防	3,900	45,513.00	0.09
288	600888	新疆众和	6,400	45,440.00	0.09
289	688322	奥比中光	972	45,198.00	0.09
290	688400	凌云光	2,052	44,979.84	0.09
291	300463	迈克生物	3,400	44,880.00	0.09
292	000062	深圳华强	2,000	44,800.00	0.09
293	002125	湘潭电化	4,400	44,352.00	0.09
294	002011	盾安环境	4,100	44,321.00	0.09

295	000582	北部湾港	5,600	44,128.00	0.09
296	300457	赢合科技	2,300	44,022.00	0.09
297	601882	海天精工	2,000	43,860.00	0.08
298	300068	南都电源	2,700	43,578.00	0.08
299	002913	奥士康	1,800	43,398.00	0.08
300	000758	中色股份	8,700	42,978.00	0.08
301	300298	三诺生物	1,600	41,296.00	0.08
302	603236	移远通信	600	41,064.00	0.08
303	688676	金盘科技	991	41,047.22	0.08
304	688502	茂莱光学	200	40,280.00	0.08
305	300170	汉得信息	3,200	39,680.00	0.08
306	603588	高能环境	7,540	39,509.60	0.08
307	600452	涪陵电力	3,680	38,971.20	0.08
308	301363	美好医疗	1,200	38,904.00	0.08
309	000767	晋控电力	15,300	38,709.00	0.07
310	002332	仙琚制药	3,800	37,772.00	0.07
311	600058	五矿发展	5,300	37,736.00	0.07
312	002991	甘源食品	400	37,408.00	0.07
313	600635	大众公用	8,400	37,380.00	0.07
314	301047	义翘神州	600	37,110.00	0.07
315	002978	安宁股份	1,300	36,946.00	0.07
316	688776	国光电气	780	36,917.40	0.07
317	688083	中望软件	430	36,795.10	0.07
318	600075	新疆天业	8,400	36,540.00	0.07
319	600490	鹏欣资源	11,100	36,519.00	0.07
320	601101	昊华能源	4,400	36,212.00	0.07
321	002539	云图控股	4,600	35,972.00	0.07
322	002215	诺普信	3,200	35,936.00	0.07
323	300679	电连技术	600	35,820.00	0.07
324	600313	农发种业	5,300	35,775.00	0.07
325	001389	广合科技	700	35,210.00	0.07
326	002946	新乳业	2,400	34,824.00	0.07
327	601137	博威合金	1,700	34,510.00	0.07
328	301177	迪阿股份	1,500	34,260.00	0.07
329	603057	紫燕食品	1,700	34,153.00	0.07
330	603719	良品铺子	2,400	34,104.00	0.07
331	600428	中远海特	4,600	33,580.00	0.06
332	300109	新开源	2,100	33,495.00	0.06
333	300039	上海凯宝	5,400	33,372.00	0.06
334	688556	高测股份	2,965	33,148.70	0.06
335	601778	晶科科技	11,700	32,994.00	0.06
336	002737	葵花药业	1,600	32,784.00	0.06
337	002003	伟星股份	2,300	32,591.00	0.06

338	002416	爱施德	2,000	32,540.00	0.06
339	601801	皖新传媒	4,400	32,296.00	0.06
340	002320	海峡股份	4,900	32,095.00	0.06
341	002701	奥瑞金	5,600	31,752.00	0.06
342	002041	登海种业	2,900	31,581.00	0.06
343	688366	昊海生科	518	31,380.44	0.06
344	002351	漫步者	1,900	31,350.00	0.06
345	600480	凌云股份	2,900	31,349.00	0.06
346	603599	广信股份	2,600	31,330.00	0.06
347	601952	苏垦农发	3,200	31,328.00	0.06
348	600908	无锡银行	5,300	31,323.00	0.06
349	603877	太平鸟	2,100	31,080.00	0.06
350	600933	爱柯迪	1,900	30,970.00	0.06
351	301050	雷电微力	600	30,948.00	0.06
352	600645	中源协和	1,600	30,880.00	0.06
353	605589	圣泉集团	1,300	30,654.00	0.06
354	000951	中国重汽	1,800	30,564.00	0.06
355	600835	上海机电	1,700	30,464.00	0.06
356	001323	慕思股份	800	30,248.00	0.06
356	002635	安洁科技	1,900	30,248.00	0.06
357	603103	横店影视	2,100	30,219.00	0.06
358	000885	城发环境	2,300	30,153.00	0.06
359	601163	三角轮胎	2,000	30,140.00	0.06
360	603690	至纯科技	1,200	30,132.00	0.06
361	688166	博瑞医药	995	30,049.00	0.06
362	600639	浦东金桥	2,700	29,970.00	0.06
363	600562	国睿科技	1,500	29,895.00	0.06
364	002484	江海股份	1,700	29,886.00	0.06
365	600710	苏美达	3,200	29,760.00	0.06
366	600475	华光环能	3,300	29,733.00	0.06
367	001213	中铁特货	7,100	29,607.00	0.06
368	002516	旷达科技	5,800	29,406.00	0.06
369	603915	国茂股份	2,500	29,300.00	0.06
370	002237	恒邦股份	2,900	29,290.00	0.06
371	301035	润丰股份	600	29,232.00	0.06
372	300761	立华股份	1,500	29,190.00	0.06
373	002222	福晶科技	900	29,160.00	0.06
374	300687	赛意信息	1,600	29,120.00	0.06
375	688289	圣湘生物	1,279	29,033.30	0.06
376	002212	天融信	4,500	29,025.00	0.06
377	002840	华统股份	2,300	29,003.00	0.06
378	600363	联创光电	600	28,728.00	0.06
379	300319	麦捷科技	2,300	28,704.00	0.06

380	002171	楚江新材	3,500	28,700.00	0.06
381	000902	新洋丰	2,200	28,688.00	0.06
382	603279	景津装备	1,600	28,608.00	0.06
383	301216	万凯新材	2,800	28,560.00	0.06
384	600552	凯盛科技	2,500	28,525.00	0.06
385	002043	兔宝宝	2,400	28,512.00	0.06
386	301090	华润材料	4,100	28,454.00	0.06
387	600751	海航科技	10,800	28,404.00	0.05
388	601015	陕西黑猫	8,500	28,390.00	0.05
389	300777	中简科技	1,000	28,290.00	0.05
390	600633	浙数文化	2,700	28,242.00	0.05
391	000049	德赛电池	1,200	28,212.00	0.05
392	603297	永新光学	300	28,146.00	0.05
393	300079	数码视讯	5,200	28,132.00	0.05
394	600728	佳都科技	6,000	28,080.00	0.05
395	600643	爱建集团	5,400	27,918.00	0.05
396	300171	东富龙	2,100	27,888.00	0.05
397	002458	益生股份	2,900	27,869.00	0.05
398	000881	中广核技	3,800	27,854.00	0.05
399	300663	科蓝软件	1,600	27,776.00	0.05
400	300428	立中集团	1,700	27,710.00	0.05
401	300820	英杰电气	500	27,625.00	0.05
402	600604	市北高新	5,800	27,608.00	0.05
403	002349	精华制药	3,600	27,540.00	0.05
404	688690	纳微科技	1,563	27,508.80	0.05
405	688739	成大生物	1,065	27,455.70	0.05
406	300226	上海钢联	1,200	27,444.00	0.05
407	002183	怡亚通	6,100	27,389.00	0.05
408	601949	中国出版	3,800	27,284.00	0.05
409	301219	腾远钴业	600	27,126.00	0.05
410	600217	中再资环	5,100	27,030.00	0.05
411	300618	寒锐钴业	800	27,016.00	0.05
412	000555	神州信息	2,400	26,880.00	0.05
413	000736	中交地产	3,100	26,660.00	0.05
414	002151	北斗星通	1,000	26,540.00	0.05
415	300525	博思软件	1,700	26,486.00	0.05
416	688123	聚辰股份	452	26,451.04	0.05
417	002537	海联金汇	4,600	26,450.00	0.05
418	000025	特力A	1,600	26,432.00	0.05
419	002101	广东鸿图	2,200	26,356.00	0.05
420	003039	顺控发展	2,000	26,160.00	0.05
421	600773	西藏城投	2,400	25,872.00	0.05
422	002675	东诚药业	2,100	25,662.00	0.05

423	000028	国药一致	870	25,447.50	0.05
424	603033	三维股份	2,000	25,380.00	0.05
425	600216	浙江医药	1,600	25,376.00	0.05
426	002023	海特高新	2,500	25,375.00	0.05
427	688372	伟测科技	432	25,280.64	0.05
428	003040	楚天龙	1,900	24,833.00	0.05
429	603013	亚普股份	1,600	23,968.00	0.05
430	300077	国民技术	1,000	23,840.00	0.05
431	603565	中谷物流	2,300	22,540.00	0.04
432	603439	贵州三力	1,700	22,100.00	0.04
433	600389	江山股份	1,500	21,675.00	0.04
434	600596	新安股份	2,400	21,072.00	0.04
435	002254	泰和新材	2,200	20,680.00	0.04
436	000930	中粮科技	3,700	20,535.00	0.04
437	603866	桃李面包	3,100	20,460.00	0.04
438	601677	明泰铝业	1,700	20,451.00	0.04
439	688190	云路股份	220	20,240.00	0.04
440	300119	瑞普生物	1,100	20,207.00	0.04
441	600195	中牧股份	3,000	20,130.00	0.04
442	300406	九强生物	1,400	18,704.00	0.04
443	688575	亚辉龙	1,180	18,644.00	0.04
444	000990	诚志股份	2,400	18,600.00	0.04
445	603567	珍宝岛	1,600	18,560.00	0.04
446	002967	广电计量	1,100	18,040.00	0.03
447	600459	贵研铂业	1,300	17,849.00	0.03
448	688403	汇成股份	1,963	17,588.48	0.03
449	600987	航民股份	2,500	17,350.00	0.03
450	601908	京运通	5,600	17,080.00	0.03
451	601038	一拖股份	1,100	16,258.00	0.03
452	600179	安通控股	5,600	15,848.00	0.03
453	688131	皓元医药	427	15,243.90	0.03
454	002314	南山控股	6,300	14,994.00	0.03
455	603323	苏农银行	2,800	14,812.00	0.03
456	002895	川恒股份	600	14,760.00	0.03
457	300451	创业慧康	3,250	14,560.00	0.03
458	688408	中信博	200	14,400.00	0.03
459	002985	北摩高科	600	14,100.00	0.03
460	002020	京新药业	1,100	14,080.00	0.03
461	688298	东方生物	468	13,726.44	0.03
462	600057	厦门象屿	2,100	13,629.00	0.03
463	300855	图南股份	600	13,152.00	0.03
464	600961	株冶集团	1,600	12,592.00	0.02
465	601528	瑞丰银行	1,900	10,697.00	0.02

466	001322	箭牌家居	1,300	10,517.00	0.02
467	301207	华兰疫苗	600	10,506.00	0.02
468	000672	上峰水泥	1,200	9,180.00	0.02
469	603876	鼎胜新材	1,000	8,850.00	0.02
470	301175	中科环保	1,600	8,640.00	0.02
471	301376	致欧科技	400	7,648.00	0.01
472	002038	双鹭药业	1,000	7,470.00	0.01
473	603368	柳药集团	300	5,358.00	0.01
474	688707	振华新材	315	3,449.25	0.01
475	002242	九阳股份	300	3,108.00	0.01
476	600395	盘江股份	300	1,527.00	0.00

8.3.2 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	002782	可立克	12,500	158,125.00	0.31
2	300369	绿盟科技	17,100	122,949.00	0.24
3	688368	晶丰明源	1,295	115,255.00	0.22
4	600295	鄂尔多斯	11,300	110,288.00	0.21
5	301165	锐捷网络	1,400	101,080.00	0.20
6	600612	老凤祥	1,600	86,832.00	0.17
7	601019	山东出版	7,600	86,260.00	0.17
8	601728	中国电信	11,300	81,586.00	0.16
9	002440	闰土股份	12,100	81,191.00	0.16
10	600284	浦东建设	12,800	80,256.00	0.16
11	300002	神州泰岳	6,800	78,812.00	0.15
12	300054	鼎龙股份	3,000	78,060.00	0.15
13	300803	指南针	800	76,760.00	0.15
14	600028	中国石化	11,400	76,152.00	0.15
15	688158	优刻得	5,346	74,737.08	0.14
16	301301	川宁生物	6,300	74,718.00	0.14
17	601399	国机重装	24,100	74,228.00	0.14
18	603979	金诚信	2,000	72,600.00	0.14
19	300065	海兰信	8,800	72,160.00	0.14
20	688381	帝奥微	3,700	71,336.00	0.14
21	600219	南山铝业	18,200	71,162.00	0.14
22	601001	晋控煤业	5,200	71,084.00	0.14
23	603948	建业股份	3,800	70,034.00	0.14
24	688600	皖仪科技	5,178	69,644.10	0.13
25	688161	威高骨科	2,688	67,791.36	0.13
26	688610	埃科光电	1,893	65,687.10	0.13
27	688319	欧林生物	6,188	65,592.80	0.13
28	300767	震安科技	6,800	61,336.00	0.12
29	688335	复洁环保	7,258	61,184.94	0.12

30	688173	希荻微	5,507	61,017.56	0.12
31	601918	新集能源	7,800	56,004.00	0.11
32	603010	万盛股份	5,200	53,404.00	0.10
33	002318	久立特材	2,100	49,161.00	0.10
34	688356	键凯科技	852	48,512.88	0.09
35	603556	海兴电力	1,300	48,087.00	0.09
36	600276	恒瑞医药	1,000	45,900.00	0.09
37	002261	拓维信息	2,500	45,775.00	0.09
38	300567	精测电子	600	38,580.00	0.07
39	600312	平高电气	1,800	34,560.00	0.07
40	603728	鸣志电器	600	32,400.00	0.06
41	600483	福能股份	3,220	32,103.40	0.06
42	600955	维远股份	2,100	32,067.00	0.06
43	000921	海信家电	1,100	31,790.00	0.06
44	000034	神州数码	900	31,545.00	0.06
45	603129	春风动力	200	31,414.00	0.06
46	600688	上海石化	10,300	31,106.00	0.06
47	605338	巴比食品	1,800	31,086.00	0.06
48	603087	甘李药业	700	30,870.00	0.06
49	600685	中船防务	1,300	30,810.00	0.06
50	601567	三星医疗	1,000	30,760.00	0.06
51	000032	深桑达 A	1,700	29,988.00	0.06
52	603179	新泉股份	700	29,890.00	0.06
53	000403	派林生物	1,400	29,582.00	0.06
54	603208	江山欧派	1,600	29,440.00	0.06
55	300765	新诺威	1,100	29,249.00	0.06
56	300263	隆华科技	4,000	29,200.00	0.06
57	002573	清新环境	7,300	29,054.00	0.06
58	600491	龙元建设	7,700	28,798.00	0.06
59	600872	中炬高新	1,300	28,626.00	0.06
60	603098	森特股份	2,900	27,840.00	0.05
61	002135	东南网架	6,500	27,625.00	0.05
62	603187	海容冷链	2,440	27,303.60	0.05
63	301358	湖南裕能	600	27,192.00	0.05
64	600720	中交设计	3,000	26,580.00	0.05
65	601858	中国科传	1,300	26,494.00	0.05
66	688033	天宜上佳	4,537	26,087.75	0.05
67	002838	道恩股份	2,200	25,982.00	0.05
68	600098	广州发展	4,000	25,680.00	0.05
69	300339	润和软件	500	25,015.00	0.05
70	601965	中国汽研	1,400	24,668.00	0.05
71	603396	金辰股份	900	24,210.00	0.05
72	688680	海优新材	711	24,017.58	0.05

73	688069	德林海	1,358	20,397.16	0.04
74	002436	兴森科技	1,800	19,998.00	0.04
75	688046	药康生物	1,355	17,411.75	0.03
76	600015	华夏银行	2,100	16,821.00	0.03
77	688733	壹石通	860	16,254.00	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600273	嘉化能源	2,254,387.00	2.66
2	603556	海兴电力	2,238,679.00	2.64
3	600037	歌华有线	2,201,411.00	2.60
4	601801	皖新传媒	2,118,653.00	2.50
5	688381	帝奥微	2,101,935.34	2.48
6	688586	江航装备	2,094,045.61	2.47
7	600688	上海石化	2,067,578.00	2.44
8	600017	日照港	2,015,039.00	2.38
9	601811	新华文轩	1,966,952.00	2.32
10	600098	广州发展	1,965,307.00	2.32
11	688232	新点软件	1,959,371.00	2.31
12	603699	纽威股份	1,942,566.00	2.29
13	600012	皖通高速	1,940,212.98	2.29
14	688127	蓝特光学	1,938,674.19	2.29
15	600623	华谊集团	1,928,935.00	2.28
16	601019	山东出版	1,921,700.00	2.27
17	601326	秦港股份	1,860,954.00	2.20
18	600285	羚锐制药	1,855,783.00	2.19
19	688206	概伦电子	1,810,190.58	2.14
20	600662	外服控股	1,809,738.00	2.14
21	601369	陕鼓动力	1,758,929.00	2.08
22	600685	中船防务	1,725,544.00	2.04

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。

8.4.2 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	601801	皖新传媒	2,644,405.00	3.12
2	600037	歌华有线	2,336,522.00	2.76
3	603556	海兴电力	2,326,993.60	2.75
4	600012	皖通高速	2,291,159.00	2.70
5	600273	嘉化能源	2,284,274.00	2.70

6	601019	山东出版	2,278,165.00	2.69
7	600688	上海石化	2,270,801.00	2.68
8	600098	广州发展	2,205,532.00	2.60
9	688381	帝奥微	2,120,373.76	2.50
10	601369	陕鼓动力	2,059,544.00	2.43
11	688232	新点软件	1,947,666.04	2.30
12	688586	江航装备	1,925,343.90	2.27
13	688127	蓝特光学	1,907,121.48	2.25
14	603171	税友股份	1,905,739.00	2.25
15	600017	日照港	1,897,189.00	2.24
16	600285	羚锐制药	1,881,654.00	2.22
17	603766	隆鑫通用	1,876,602.00	2.21
18	002130	沃尔核材	1,865,723.00	2.20
19	600502	安徽建工	1,859,834.00	2.19
20	688209	英集芯	1,851,276.29	2.18
21	603699	纽威股份	1,830,751.00	2.16
22	688206	概伦电子	1,816,391.68	2.14
23	600750	江中药业	1,801,655.00	2.13
24	603989	艾华集团	1,800,457.00	2.12
25	601811	新华文轩	1,790,476.00	2.11
26	603393	新天然气	1,785,594.60	2.11
27	601326	秦港股份	1,737,973.00	2.05
28	300143	盈康生命	1,728,881.50	2.04
29	600685	中船防务	1,699,856.00	2.01

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。

8.4.3 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	633,101,621.18
卖出股票收入（成交）总额	657,106,686.83

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	450,595.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	450,595.52

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名的股票不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
765	66,541.30	28,161,212.00	55.32	22,742,879.00	44.68

9.2 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	方正证券股份有限公司	6,121,945.00	12.03
2	国信证券股份有限公司	5,414,964.00	10.64
3	广发证券股份有限公司	4,125,447.00	8.10
4	招商证券股份有限公司	3,559,388.00	6.99
5	中信证券股份有限公司	3,462,822.00	6.80
6	周琪	1,600,000.00	3.14
7	国泰君安证券股份有限公司	1,575,171.00	3.09
8	东方证券股份有限公司	1,028,055.00	2.02
9	中国银河证券股份有限公司	970,815.00	1.91
10	海通证券股份有限公司	910,402.00	1.79

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。

9.3 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。

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 11 月 24 日） 基金份额总额	1,250,904,091.00
本报告期期初基金份额总额	86,904,091.00
本报告期基金总申购份额	240,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	276,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	50,904,091.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内支付给容诚会计师事务所（特殊普通

合伙) 的报酬共计人民币 20,000.00 元。 该审计机构已经为本基金提供了 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	2	539,624,856.76	41.82	146,584.33	42.47	-
申万宏源	1	535,907,071.28	41.54	143,370.02	41.54	-
西南证券	4	127,480,299.56	9.88	42,471.09	12.31	-
国金证券	2	87,196,080.41	6.76	12,722.00	3.69	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	0	-	-	-	-	撤销 2 个交易单元
第一创业	2	-	-	-	-	-
东北证券	5	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	0	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-

宏信证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

4、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024年6月30日前完成股票交易佣金费率的调整。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
红塔证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-

平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源西部 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证	-	-	-	-	-	-

券						
中原证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 1 月 2 日
2	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 1 月 19 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 1 月 25 日
5	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 25 日
6	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2024 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 25 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 2 月 7 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报, 上海证券报	2024 年 2 月 26 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 5 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 19 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 3 月 29 日
12	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日

13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 3 月 29 日
14	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 4 月 15 日
15	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
16	《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
17	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 4 月 26 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 5 月 29 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于增加东方证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报, 上海证券报	2024 年 6 月 14 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整清算交收条款并修订招募说明书的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2024 年 6 月 20 日
21	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2024 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 20 日
22	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 6 月 24 日
23	《银华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
24	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
25	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 7 月 1 日
26	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 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 7 月 18 日
27	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公	四大证券报	2024 年 7 月 18 日

	告》		
28	《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 7 月 24 日
29	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报, 上海证券报	2024 年 7 月 26 日
30	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 8 月 6 日
31	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 31 日
32	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 8 月 31 日
33	《银华基金管理股份有限公司关于指定旗下部分基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报, 上海证券报	2024 年 9 月 26 日
34	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 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 10 月 24 日
35	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 10 月 24 日
36	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2024 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 8 日
37	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 8 日
38	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告》	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 12 月 12 日
39	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 12 月 20 日
40	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2024 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20240719-20240722	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20240724-20240724	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20240726-20240806	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20241108-20241111	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20241021-20241021	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20241031-20241031	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20241105-20241106	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02
	1	20240918-20241010	0.00	112,052,746.00	111,024,691.00	1,028,055.00	2.02

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2024 年 6 月 20 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整清算交收条款并修订招募说明书的公告》，自 2024 年 6 月 21 日起，调整旗下本基金招募说明书的清算交收条款。

2、本基金管理人于 2024 年 12 月 12 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》，自 2024 年 12 月 12 日起，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.4 《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 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。

13.3 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

2025 年 3 月 28 日