

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证 券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 3 月 19 日（合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	14
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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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
§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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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的情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	65

§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
备查文件目录	69
11.3 备查文件目录.....	69
11.4 存放地点.....	69
11.5 查阅方式.....	69

§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	银华 MSCI
场内简称	银华 MSCI
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	1,932,805,582.00 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。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 东方广场东方经贸城 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	陈四清

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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(2019年3月19日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-25,079,016.42
本期利润	-82,353,391.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0404
本期加权平均净值利润率	-4.20%
本期基金份额净值增长率	-4.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-71,016,337.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0367
期末基金资产净值	1,861,789,244.61
期末基金份额净值	0.9633
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.31%

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。

4、本基金于2019年3月19日成立，截止到本报告期末未满半年，主要财务指标的实际计算期间为2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日。

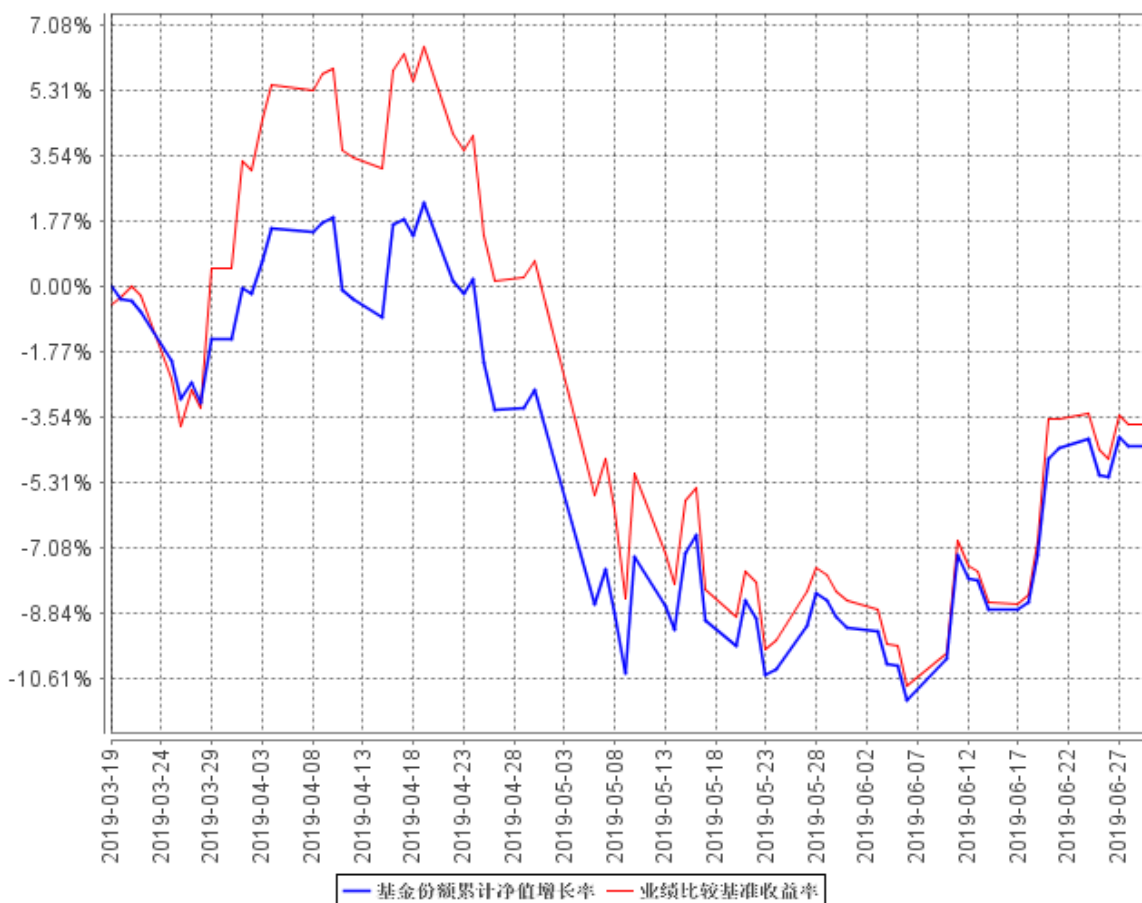
3.2 基金净值表现

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	5.38%	1.16%	5.24%	1.32%	0.14%	-0.16%
过去三个月	-2.96%	1.47%	-4.21%	1.66%	1.25%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-4.31%	1.39%	-3.71%	1.64%	-0.60%	-0.25%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为2019年3月19日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例应当符合基金合同的规定。

§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%，山西海鑫实业股份有限公司 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 115 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、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、银华全球核心优选证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、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)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(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、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财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、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、

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、银华逆向投资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、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、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、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、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）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、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、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车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、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、银华文体娱乐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、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、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、银华智荟分红收益灵活配置混合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、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、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、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈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、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、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华安享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 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、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。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	-	10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日起兼任上证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日起兼任银华上证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 日起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 日起兼任银华 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。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2019 年 5 月 28 日	-	8 年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
张亦驰先生	本基金的基金经理助理	2019 年 5 月 28 日	-	4.5 年	硕士学位，曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员，现任基金经理助理。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、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

3、刘文魁先生自 2019 年 8 月 8 日起开始担任本基金基金经理助理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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1次，原因是指数型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

2019年上半年，股市走势震荡。一方面，估值水平大幅修复，市场存在调整风险；另一方面，在经济下行压力加大的背景下，企业盈利增速进一步下行，加之中美贸易摩擦等事件影响，市场风险偏好调整，重新回到中性状态。

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平，并取得一定的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9633；本报告期基金份额净值增长率为-4.31%，同期业绩比较基准收益率为-3.71%。

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 2019 年下半年，我们对市场持谨慎乐观态度。

从宏观层面来看，在经济基本面临向下的压力，企业盈利底部徘徊以及中美博弈成为“新常态”的大背景下，需谨慎应对。同时，后续 G20 会议、科创板上市、70 周年国庆等重要事件前后，风险偏好又有可能阶段性提升。股市经过上半年的上涨和调整，市场风险得到一定程度的释放，减税降费政策，积极财政政策和全球降息预期升温也会对市场构成支持，此外，随着富时罗素纳入 A 股和 MSCI 纳入 A 股继续扩容，外资的进入会为资本市场带来新活力。有利于进一步推动内地股票市场的对外开放，为 A 股市场引入长期资金。我们对 2019 年下半年市场持谨慎乐观态度。

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 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

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，本基金托管人在对银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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，银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	19,882,993.48
结算备付金		1,626,225.13
存出保证金		370,509.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,843,566,983.68
其中：股票投资		1,843,566,983.68
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		9,771,986.96
应收利息	6.4.7.5	5,175.07
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,875,223,873.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		10,095,142.64
应付赎回款		-
应付管理人报酬		762,367.99
应付托管费		152,473.57
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,104,219.24
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	320,425.61
负债合计		13,434,629.05
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,932,805,582.00
未分配利润	6.4.7.10	-71,016,337.39
所有者权益合计		1,861,789,244.61
负债和所有者权益总计		1,875,223,873.66

注：1：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.9633 元，基金份额为 1,932,805,582.00 份。

2：本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

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：2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-74,558,734.47
1.利息收入		803,291.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	803,291.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,195,011.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-37,910,722.64
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	19,715,711.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-57,274,375.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	107,360.47
减:二、费用		7,794,657.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,765,764.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	553,152.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,169,651.08
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	306,088.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-82,353,391.60
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-82,353,391.60

6.3 所有者权益(基金净值)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: 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,058,805,582.00	-	2,058,805,582.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-82,353,391.60	-82,353,391.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-126,000,000.00	11,337,054.21	-114,662,945.79
其中: 1. 基金申购款	87,000,000.00	-4,194,332.72	82,805,667.28
2. 基金赎回款	-213,000,000.00	15,531,386.93	-197,468,613.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,932,805,582.00	-71,016,337.39	1,861,789,244.61

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《关于准予银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予募集注册并公开发行,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》及有关规定和《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”)发起,于 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 3 月 11 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式证券投资基金,存续期限为不定期。设立时募集扣除认购费后的实收基金现金部分为人民币 1,133,760,000.00 元,折算成基金份额计 1,133,760,000.00 份;截至 2019 年 3 月 15 日止募集的实收基金股票部分由中国证券登记结算有限责任公司办理过户至户名为“中国工商银行股份有限公司-银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金”(账号: D890160209) 和“中国工商银行股份有限公司-银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金”(账号: 0899184686)的证券账户的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 925,045,582.00 元,折算成基金份额计 925,045,582.00 份。以上实收基金(本息)合计为人民币 2,058,805,582.00 元,折算成基金份额计 2,058,805,582.00 份。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 3 月 19 日生效。银华基金管理股份有限公司担任基金管理人,中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构,中国工商银行股份有限公司担任基金托管人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无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。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担

的新金融负债)之间的差额, 计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为:

第一层次: 输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次: 输入值是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: 输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下:

1. 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值, 调整最近交易市价, 确定公允价值;

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票, 以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值;

B. 首次公开发行的股票, 采用估值技术确定公允价值;

(3) 流通受限股票的估值

对于发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票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, 按中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2. 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价

不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3. 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4. 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中的相关原则进行估值。

5. 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认;
- (8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
- (9) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;
- (10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
- (11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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;基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见招募说明书;

(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定,如基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(4) 本基金收益分配方式采取现金分红;

(5) 每一基金份额享有同等分配权;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以

下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	19,882,993.48
定期存款	-
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	-
合计：	19,882,993.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,900,841,358.86	1,843,566,983.68	-57,274,375.18
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	1,900,841,358.86	1,843,566,983.68	-57,274,375.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	4,276.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	731.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	166.80
合计	5,175.07

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,104,219.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,104,219.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	28,889.12
应付指数使用费	276,576.49
应付其他	14,960.00
合计	320,425.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,058,805,582.00	2,058,805,582.00
本期申购	87,000,000.00	87,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-213,000,000.00	-213,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,932,805,582.00	1,932,805,582.00

注：1：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2：本基金于2019年1月2日至2019年3月11日向社会公开募集，截至2019年3月19日(基金合同生效日)止，募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币1,133,760,000.00元，登记机构计算并确认的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币925,045,582.00元，以上实收基金(本息)合计为人民币2,058,805,582.00元，折合2,058,805,582.00份基金份额。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-25,079,016.42	-57,274,375.18	-82,353,391.60
本期基金份额交易产生的变动数	1,522,955.87	9,814,098.34	11,337,054.21
其中：基金申购款	-1,087,171.01	-3,107,161.71	-4,194,332.72
基金赎回款	2,610,126.88	12,921,260.05	15,531,386.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,556,060.55	-47,460,276.84	-71,016,337.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
活期存款利息收入	775,130.07
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	27,091.04
其他	1,070.36
合计	803,291.47

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-31,096,882.92
股票投资收益——赎回差价收入	-6,813,839.72
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-37,910,722.64

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
卖出股票成交总额	1,114,430,428.86
减：卖出股票成本总额	1,145,527,311.78
买卖股票差价收入	-31,096,882.92

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	197,468,613.07
减：现金支付赎回款总额	71,247,817.07
减：赎回股票成本总额	133,034,635.72
赎回差价收入	-6,813,839.72

6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
股票投资产生的股利收益	19,715,711.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,715,711.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-57,274,375.18
——股票投资	-57,274,375.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-57,274,375.18

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	107,360.47
合计	107,360.47

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
交易所市场交易费用	4,169,651.08
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,169,651.08

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月19日(基金合同生效日)至 2019年6月30日
审计费用	28,889.12
信息披露费	-
银行费用	223.00
指数使用费	276,576.49

其他	400.00
合计	306,088.61

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

本基金管理人于 2019 年 4 月 13 日发布《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称及住所变更的公告》，公司全资子公司（原银华财富资本管理（北京）有限公司）已完成名称及住所变更，并已办理变更工商登记。名称变更为“银华资本管理（珠海横琴）有限公司”，住所变更为“珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-67069（集中办公区）”。

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”）	基金管理人股东
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	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
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（银华 MSCI 中国 A 股 ETF 发起式联接）	本基金的联接基金

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。

6.4.10 本报告期的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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
	2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,765,764.56
其中：支付销售机构的客户维护费	91,431.45

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
	2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	553,152.88

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。

6.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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 2019年6月30日	
	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	5,014,584.00	0.26%
银华 MSCI 中国 A 股 ETF 发起式联接	107,300,000.00	5.55%

6.4.10.5 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 2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	19,882,993.48	775,130.07

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 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发行的股票：工商银行（代码 601398）4,021,700 股，期末公允价值为人民币 23,687,813.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.27%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东发行的股票：东北证券（代码 000686）174,300 股，期末公允价值为人民币 1,535,583.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.08%；投资于基金管理人股东发行的股票：第一创业（代码 002797）261,800 股，期末公允价值为人民币 1,659,812.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.09%。

本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 19 日，无上年度末数据。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2019 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	可流通日	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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

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

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；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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随时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。

本基金主要投资于上市交易的证券，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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和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 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月- 1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,882,993.48	-	-	-	-	-	19,882,993.48
结算备付金	1,626,225.13	-	-	-	-	-	1,626,225.13
存出保证金	370,509.34	-	-	-	-	-	370,509.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,843,566,983.68	1,843,566,983.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,771,986.96	9,771,986.96
应收利息	-	-	-	-	-	5,175.07	5,175.07
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	21,879,727.95	-	-	-	-	1,853,344,145.71	1,875,223,873.66
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	762,367.99	762,367.99
应付托管费	-	-	-	-	-	152,473.57	152,473.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,104,219.24	2,104,219.24
其他负债	-	-	-	-	-	320,425.61	320,425.61
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,095,142.64	10,095,142.64
负债总计	-	-	-	-	-	13,434,629.05	13,434,629.05
利率敏感度缺口	21,879,727.95	-	-	-	-	1,839,909,516.66	1,861,789,244.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	1,843,566,983.68	99.02
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	1,843,566,983.68	99.02

6.4.13.4.2.2 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%基金资产净值相应变化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。	
	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（2019年6月30日）
		+5%
-5%	-75,806,995.37	

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

6.4.14 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	1,843,566,983.68	98.31
	其中：股票	1,843,566,983.68	98.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,509,218.61	1.15
8	其他各项资产	10,147,671.37	0.54
9	合计	1,875,223,873.66	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	25,117,248.76	1.35
B	采矿业	65,311,289.42	3.51
C	制造业	807,875,009.83	43.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,051,423.50	2.53
E	建筑业	45,873,191.10	2.46
F	批发和零售业	37,715,942.94	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	54,880,444.91	2.95
H	住宿和餐饮业	2,334,900.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,861,215.71	4.61
J	金融业	525,178,102.56	28.21
K	房地产业	89,471,634.69	4.81
L	租赁和商务服务业	24,312,397.00	1.31

M	科学研究和技术服务业	1,755,006.72	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	3,080,411.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,992,454.10	0.70
R	文化、体育和娱乐业	11,945,628.44	0.64
S	综合	2,811,390.00	0.15
	合计	1,843,567,690.68	99.02

7.2.2 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股票投资。

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

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	94,697	93,181,848.00	5.00
2	601318	中国平安	808,469	71,638,438.09	3.85
3	600036	招商银行	1,535,075	55,231,998.50	2.97
4	000858	五粮液	289,005	34,088,139.75	1.83
5	601166	兴业银行	1,550,263	28,354,310.27	1.52
6	600000	浦发银行	2,186,847	25,542,372.96	1.37
7	601398	工商银行	4,021,700	23,687,813.00	1.27
8	600276	恒瑞医药	330,310	21,800,460.00	1.17
9	000002	万科 A	727,106	20,220,817.86	1.09
10	601288	农业银行	5,547,200	19,969,920.00	1.07
11	600900	长江电力	1,095,325	19,606,317.50	1.05
12	002415	海康威视	698,250	19,257,735.00	1.03
13	601668	中国建筑	3,132,200	18,010,150.00	0.97
14	601328	交通银行	2,931,800	17,942,616.00	0.96
15	000001	平安银行	1,282,654	17,674,972.12	0.95
16	603288	海天味业	167,315	17,568,075.00	0.94
17	600030	中信证券	735,100	17,502,731.00	0.94
18	601601	中国太保	469,500	17,141,445.00	0.92
19	600016	民生银行	2,647,100	16,809,085.00	0.90
20	000333	美的集团	300,917	15,605,555.62	0.84
21	600887	伊利股份	454,202	15,174,888.82	0.82
22	600104	上汽集团	582,000	14,841,000.00	0.80

23	601766	中国中车	1,819,200	14,717,328.00	0.79
24	600050	中国联通	2,315,300	14,262,248.00	0.77
25	300498	温氏股份	397,400	14,250,764.00	0.77
26	002304	洋河股份	112,101	13,626,997.56	0.73
27	601888	中国国旅	146,100	12,951,765.00	0.70
28	600585	海螺水泥	298,200	12,375,300.00	0.66
29	000651	格力电器	223,800	12,309,000.00	0.66
30	600048	保利地产	888,400	11,335,984.00	0.61
31	601818	光大银行	2,964,400	11,294,364.00	0.61
32	601688	华泰证券	487,300	10,876,536.00	0.58
33	600028	中国石化	1,903,100	10,409,957.00	0.56
34	601211	国泰君安	561,000	10,294,350.00	0.55
35	001979	招商蛇口	491,481	10,271,952.90	0.55
36	601988	中国银行	2,607,000	9,750,180.00	0.52
37	601229	上海银行	814,731	9,654,562.35	0.52
38	601989	中国重工	1,706,400	9,487,584.00	0.51
39	002142	宁波银行	389,230	9,434,935.20	0.51
40	601169	北京银行	1,578,800	9,330,708.00	0.50
41	600019	宝钢股份	1,386,056	9,009,364.00	0.48
42	601006	大秦铁路	1,111,100	8,988,799.00	0.48
43	000568	泸州老窖	108,900	8,802,387.00	0.47
44	000725	京东方 A	2,528,800	8,699,072.00	0.47
45	601336	新华保险	156,520	8,613,295.60	0.46
46	600837	海通证券	606,300	8,603,397.00	0.46
47	601186	中国铁建	861,000	8,566,950.00	0.46
48	000063	中兴通讯	256,713	8,350,873.89	0.45
49	601857	中国石油	1,203,100	8,277,328.00	0.44
50	002024	苏宁易购	695,200	7,980,896.00	0.43
51	600690	青岛海尔	454,900	7,865,221.00	0.42
52	600031	三一重工	582,200	7,615,176.00	0.41
53	002475	立讯精密	307,040	7,611,521.60	0.41
54	600015	华夏银行	957,900	7,375,830.00	0.40
55	601933	永辉超市	714,100	7,290,961.00	0.39
56	600340	华夏幸福	223,049	7,264,705.93	0.39
57	600999	招商证券	424,900	7,261,541.00	0.39
58	300015	爱尔眼科	230,530	7,139,514.10	0.38
59	000166	申万宏源	1,402,762	7,027,837.62	0.38
60	002594	比亚迪	135,700	6,882,704.00	0.37
61	601088	中国神华	328,700	6,698,906.00	0.36

62	601155	新城控股	167,600	6,672,156.00	0.36
63	300059	东方财富	485,700	6,581,235.00	0.35
64	000538	云南白药	78,211	6,524,361.62	0.35
65	600406	国电南瑞	342,634	6,386,697.76	0.34
66	600919	江苏银行	863,530	6,269,227.80	0.34
67	601012	隆基股份	270,970	6,262,116.70	0.34
68	000776	广发证券	441,986	6,072,887.64	0.33
69	002714	牧原股份	103,144	6,063,835.76	0.33
70	600009	上海机场	71,900	6,023,782.00	0.32
71	601628	中国人寿	207,600	5,879,232.00	0.32
72	002027	分众传媒	1,096,700	5,801,543.00	0.31
73	601225	陕西煤业	622,100	5,748,204.00	0.31
74	600010	宝钢股份	3,399,900	5,745,831.00	0.31
75	600547	山东黄金	139,000	5,722,630.00	0.31
76	000338	潍柴动力	447,445	5,499,099.05	0.30
77	000876	新希望	314,800	5,468,076.00	0.29
78	601985	中国核电	969,200	5,388,752.00	0.29
79	600436	片仔癀	46,700	5,379,840.00	0.29
80	601939	建设银行	716,977	5,334,308.88	0.29
81	601009	南京银行	633,600	5,233,536.00	0.28
82	002230	科大讯飞	157,164	5,224,131.36	0.28
83	603993	洛阳钼业	1,316,900	5,214,924.00	0.28
84	000895	双汇发展	205,800	5,122,362.00	0.28
85	300760	迈瑞医疗	31,214	5,094,124.80	0.27
86	600741	华域汽车	235,000	5,076,000.00	0.27
87	601669	中国电建	950,700	5,029,203.00	0.27
88	600588	用友网络	185,918	4,997,475.84	0.27
89	600029	南方航空	641,550	4,952,766.00	0.27
90	601899	紫金矿业	1,292,399	4,872,344.23	0.26
91	600958	东方证券	445,640	4,759,435.20	0.26
92	600115	东方航空	734,853	4,607,528.31	0.25
93	600809	山西汾酒	64,600	4,460,630.00	0.24
94	000661	长春高新	13,090	4,424,420.00	0.24
95	600018	上港集团	634,500	4,327,290.00	0.23
96	600332	白云山	104,206	4,269,319.82	0.23
97	300122	智飞生物	98,753	4,256,254.30	0.23
98	000069	华侨城 A	612,000	4,253,400.00	0.23
99	601901	方正证券	594,189	4,224,683.79	0.23
100	600606	绿地控股	607,400	4,148,542.00	0.22

101	600570	恒生电子	59,880	4,080,822.00	0.22
102	600438	通威股份	289,100	4,064,746.00	0.22
103	300033	同花顺	41,300	4,062,268.00	0.22
104	601618	中国中冶	1,331,300	4,047,152.00	0.22
105	600383	金地集团	337,800	4,029,954.00	0.22
106	002736	国信证券	305,905	4,025,709.80	0.22
107	600886	国投电力	506,900	3,938,613.00	0.21
108	601600	中国铝业	977,600	3,832,192.00	0.21
109	600352	浙江龙盛	242,500	3,824,225.00	0.21
110	600196	复星医药	151,000	3,820,300.00	0.21
111	600893	航发动力	167,400	3,801,654.00	0.20
112	300750	宁德时代	54,500	3,753,960.00	0.20
113	600795	国电电力	1,460,900	3,710,686.00	0.20
114	600061	国投资本	263,400	3,690,234.00	0.20
115	601877	正泰电器	159,800	3,689,782.00	0.20
116	600705	中航资本	671,600	3,640,072.00	0.20
117	002311	海大集团	117,800	3,640,020.00	0.20
118	601138	工业富联	293,500	3,536,675.00	0.19
119	600111	北方稀土	271,800	3,489,912.00	0.19
120	000596	古井贡酒	29,413	3,485,734.63	0.19
121	600703	三安光电	303,900	3,427,992.00	0.18
122	600660	福耀玻璃	150,200	3,414,046.00	0.18
123	000100	TCL 集团	1,011,900	3,369,627.00	0.18
124	601377	兴业证券	499,900	3,369,326.00	0.18
125	000963	华东医药	129,520	3,362,339.20	0.18
126	601788	光大证券	290,900	3,322,078.00	0.18
127	000768	中航飞机	207,230	3,263,872.50	0.18
128	300142	沃森生物	114,478	3,246,596.08	0.17
129	002236	大华股份	222,900	3,236,508.00	0.17
130	000783	长江证券	413,980	3,233,183.80	0.17
131	600271	航天信息	139,400	3,213,170.00	0.17
132	002202	金风科技	258,378	3,211,638.54	0.17
133	002032	苏泊尔	42,100	3,192,443.00	0.17
134	600926	杭州银行	383,046	3,190,773.18	0.17
135	002422	科伦药业	106,900	3,178,137.00	0.17
136	002007	华兰生物	103,900	3,167,911.00	0.17
137	601727	上海电气	585,400	3,149,452.00	0.17
138	601021	春秋航空	68,500	3,082,500.00	0.17
139	002001	新和成	159,600	3,078,684.00	0.17

140	300003	乐普医疗	133,100	3,063,962.00	0.16
141	002146	荣盛发展	325,000	3,051,750.00	0.16
142	600482	中国动力	128,300	3,030,446.00	0.16
143	603899	晨光文具	68,700	3,020,739.00	0.16
144	002352	顺丰控股	88,700	3,012,252.00	0.16
145	603589	口子窖	46,600	3,001,972.00	0.16
146	300347	泰格医药	38,400	2,960,640.00	0.16
147	601108	财通证券	268,500	2,948,130.00	0.16
148	600085	同仁堂	101,600	2,946,400.00	0.16
149	002157	正邦科技	176,100	2,933,826.00	0.16
150	600674	川投能源	329,100	2,928,990.00	0.16
151	000703	恒逸石化	212,800	2,906,848.00	0.16
152	002044	美年健康	232,500	2,892,300.00	0.16
153	000157	中联重科	478,600	2,876,386.00	0.15
154	300124	汇川技术	123,984	2,840,473.44	0.15
155	601111	中国国航	296,600	2,838,462.00	0.15
156	600004	白云机场	155,400	2,828,280.00	0.15
157	002410	广联达	84,800	2,789,072.00	0.15
158	600346	恒力石化	227,340	2,764,454.40	0.15
159	600297	广汇汽车	610,300	2,721,938.00	0.15
160	600637	东方明珠	256,500	2,703,510.00	0.15
161	002916	深南电路	26,162	2,666,431.04	0.14
162	002493	荣盛石化	220,000	2,653,200.00	0.14
163	600489	中金黄金	257,800	2,647,606.00	0.14
164	002673	西部证券	261,814	2,639,085.12	0.14
165	603369	今世缘	94,600	2,638,394.00	0.14
166	601607	上海医药	144,000	2,613,600.00	0.14
167	000425	徐工机械	585,500	2,611,330.00	0.14
168	002179	中航光电	77,100	2,579,766.00	0.14
169	600600	青岛啤酒	51,600	2,576,388.00	0.14
170	000860	顺鑫农业	55,080	2,569,482.00	0.14
171	600872	中炬高新	59,306	2,540,075.98	0.14
172	300408	三环集团	130,290	2,534,140.50	0.14
173	601998	中信银行	423,200	2,526,504.00	0.14
174	002506	协鑫集成	378,100	2,525,708.00	0.14
175	002271	东方雨虹	110,900	2,512,994.00	0.13
176	600176	中国巨石	261,800	2,494,954.00	0.13
177	300144	宋城演艺	107,800	2,494,492.00	0.13
178	300601	康泰生物	47,500	2,493,750.00	0.13

179	600487	亨通光电	148,500	2,488,860.00	0.13
180	600516	方大炭素	201,615	2,477,848.35	0.13
181	600362	江西铜业	155,900	2,453,866.00	0.13
182	601198	东兴证券	206,500	2,453,220.00	0.13
183	600498	烽火通信	87,984	2,451,234.24	0.13
184	002371	北方华创	35,100	2,430,675.00	0.13
185	601919	中远海控	480,600	2,412,612.00	0.13
186	000656	金科股份	399,400	2,408,382.00	0.13
187	000961	中南建设	277,700	2,404,882.00	0.13
188	002153	石基信息	66,300	2,399,397.00	0.13
189	600183	生益科技	159,000	2,392,950.00	0.13
190	601838	成都银行	270,200	2,385,866.00	0.13
191	000709	河钢股份	793,900	2,373,761.00	0.13
192	002405	四维图新	147,150	2,369,115.00	0.13
193	600688	上海石化	456,500	2,355,540.00	0.13
194	600867	通化东宝	152,600	2,350,040.00	0.13
195	603019	中科曙光	66,800	2,344,680.00	0.13
196	601992	金隅集团	622,500	2,340,600.00	0.13
197	601800	中国交建	204,800	2,318,336.00	0.12
198	603833	欧派家居	21,500	2,313,830.00	0.12
199	000728	国元证券	251,235	2,303,824.95	0.12
200	000786	北新建材	126,200	2,288,006.00	0.12
201	601555	东吴证券	222,647	2,282,131.75	0.12
202	000977	浪潮信息	95,300	2,273,858.00	0.12
203	000066	中国长城	219,900	2,260,572.00	0.12
204	002601	龙鳞佰利	152,400	2,260,092.00	0.12
205	601117	中国化学	367,900	2,214,758.00	0.12
206	600011	华能国际	355,200	2,212,896.00	0.12
207	300450	先导智能	65,800	2,210,880.00	0.12
208	002050	三花智控	207,322	2,187,247.10	0.12
209	600109	国金证券	225,000	2,187,000.00	0.12
210	600875	东方电气	205,652	2,184,024.24	0.12
211	002466	天齐锂业	85,800	2,169,024.00	0.12
212	002049	紫光国微	49,144	2,167,741.84	0.12
213	002555	三七互娱	159,641	2,163,135.55	0.12
214	000999	华润三九	73,400	2,153,556.00	0.12
215	002241	歌尔股份	242,000	2,151,380.00	0.12
216	600068	葛洲坝	344,570	2,146,671.10	0.12
217	600066	宇通客车	164,500	2,141,790.00	0.12

218	601360	三六零	100,000	2,138,000.00	0.11
219	300413	芒果超媒	51,800	2,126,390.00	0.11
220	601233	桐昆股份	136,200	2,112,462.00	0.11
221	000413	东旭光电	410,200	2,108,428.00	0.11
222	600522	中天科技	228,355	2,094,015.35	0.11
223	601997	贵阳银行	239,985	2,075,870.25	0.11
224	601216	君正集团	630,100	2,073,029.00	0.11
225	600816	安信信托	410,100	2,071,005.00	0.11
226	601100	恒立液压	65,929	2,068,852.02	0.11
227	000050	深天马 A	153,776	2,066,749.44	0.11
228	002081	金螳螂	200,200	2,064,062.00	0.11
229	002926	华西证券	196,101	2,059,060.50	0.11
230	002127	南极电商	183,000	2,056,920.00	0.11
231	300628	亿联网络	19,200	2,055,744.00	0.11
232	600801	华新水泥	100,980	2,044,845.00	0.11
233	600642	申能股份	340,200	2,044,602.00	0.11
234	002372	伟星新材	117,220	2,039,628.00	0.11
235	600536	中国软件	38,000	2,039,460.00	0.11
236	002129	中环股份	208,500	2,034,960.00	0.11
237	600760	中航沈飞	69,800	2,026,294.00	0.11
238	600398	海澜之家	222,898	2,021,684.86	0.11
239	002600	领益智造	340,500	2,019,165.00	0.11
240	600208	新湖中宝	642,400	2,017,136.00	0.11
241	600089	特变电工	278,100	2,016,225.00	0.11
242	300529	健帆生物	32,200	2,007,670.00	0.11
243	600118	中国卫星	88,900	2,004,695.00	0.11
244	600188	兖州煤业	183,900	1,998,993.00	0.11
245	000627	天茂集团	307,103	1,993,098.47	0.11
246	600161	天坛生物	78,640	1,985,660.00	0.11
247	600655	豫园股份	241,228	1,975,657.32	0.11
248	002460	赣锋锂业	83,900	1,965,777.00	0.11
249	002299	圣农发展	77,600	1,964,832.00	0.11
250	000975	银泰资源	148,600	1,960,034.00	0.11
251	000671	阳光城	302,000	1,956,960.00	0.11
252	300017	网宿科技	181,400	1,955,492.00	0.11
253	300014	亿纬锂能	64,000	1,949,440.00	0.10
254	000938	紫光股份	71,378	1,945,050.50	0.10
255	600298	安琪酵母	61,300	1,938,919.00	0.10
256	601238	广汽集团	177,300	1,937,889.00	0.10

257	000630	铜陵有色	786,800	1,935,528.00	0.10
258	601878	浙商证券	208,000	1,934,400.00	0.10
259	000423	东阿阿胶	48,407	1,927,566.74	0.10
260	002508	老板电器	71,000	1,926,940.00	0.10
261	000625	长安汽车	290,400	1,925,352.00	0.10
262	300383	光环新网	114,500	1,920,165.00	0.10
263	600027	华电国际	507,000	1,911,390.00	0.10
264	600779	水井坊	37,600	1,910,832.00	0.10
265	600528	中铁工业	165,101	1,910,218.57	0.10
266	603986	兆易创新	21,800	1,890,060.00	0.10
267	002373	千方科技	110,400	1,887,840.00	0.10
268	600153	建发股份	212,400	1,886,112.00	0.10
269	600535	天士力	112,500	1,861,875.00	0.10
270	002013	中航机电	269,937	1,857,166.56	0.10
271	600038	中直股份	45,268	1,856,893.36	0.10
272	600583	海油工程	330,600	1,851,360.00	0.10
273	002223	鱼跃医疗	75,100	1,848,962.00	0.10
274	002010	传化智联	242,900	1,829,037.00	0.10
275	300070	碧水源	234,700	1,828,313.00	0.10
276	600566	济川药业	60,700	1,827,677.00	0.10
277	002558	巨人网络	99,900	1,815,183.00	0.10
278	600977	中国电影	115,900	1,814,994.00	0.10
279	601099	太平洋	509,100	1,812,396.00	0.10
280	002180	纳思达	80,000	1,808,000.00	0.10
281	600426	华鲁恒升	121,400	1,804,004.00	0.10
282	600256	广汇能源	506,500	1,803,140.00	0.10
283	002439	启明星辰	67,000	1,802,300.00	0.10
284	002507	涪陵榨菜	58,700	1,790,350.00	0.10
285	300136	信维通信	73,100	1,787,295.00	0.10
286	601699	潞安环能	224,501	1,782,537.94	0.10
287	300024	机器人	116,200	1,769,726.00	0.10
288	600909	华安证券	270,537	1,769,311.98	0.10
289	000402	金融街	224,700	1,761,648.00	0.09
290	603885	吉祥航空	134,300	1,759,330.00	0.09
291	000401	冀东水泥	99,800	1,757,478.00	0.09
292	600673	东阳光	223,800	1,756,830.00	0.09
293	300676	华大基因	30,768	1,755,006.72	0.09
294	002384	东山精密	119,900	1,746,943.00	0.09
295	600998	九州通	140,700	1,739,052.00	0.09

296	603799	华友钴业	80,980	1,725,683.80	0.09
297	600376	首开股份	192,400	1,718,132.00	0.09
298	002500	山西证券	211,932	1,716,649.20	0.09
299	300253	卫宁健康	120,908	1,714,475.44	0.09
300	603858	步长制药	66,200	1,705,974.00	0.09
301	300433	蓝思科技	244,100	1,701,377.00	0.09
302	002110	三钢闽光	182,750	1,699,575.00	0.09
303	601098	中南传媒	134,400	1,698,816.00	0.09
304	002624	完美世界	65,400	1,687,974.00	0.09
305	002385	大北农	317,000	1,676,930.00	0.09
306	002195	二三四五	430,900	1,676,201.00	0.09
307	600415	小商品城	406,100	1,673,132.00	0.09
308	002797	第一创业	261,800	1,659,812.00	0.09
309	600739	辽宁成大	113,900	1,656,106.00	0.09
310	002353	杰瑞股份	71,600	1,653,960.00	0.09
311	002465	海格通信	171,739	1,638,390.06	0.09
312	002399	海普瑞	77,962	1,636,422.38	0.09
313	002065	东华软件	232,000	1,621,680.00	0.09
314	600372	中航电子	108,800	1,614,592.00	0.09
315	600460	士兰微	97,100	1,611,860.00	0.09
316	601866	中远海发	591,200	1,608,064.00	0.09
317	002456	欧菲光	203,100	1,592,304.00	0.09
318	000750	国海证券	314,718	1,583,031.54	0.09
319	000031	大悦城	244,000	1,566,480.00	0.08
320	600315	上海家化	49,700	1,548,155.00	0.08
321	000732	泰禾集团	93,800	1,547,700.00	0.08
322	601966	玲珑轮胎	90,400	1,536,800.00	0.08
323	000686	东北证券	174,300	1,535,583.00	0.08
324	600584	长电科技	119,400	1,534,290.00	0.08
325	002268	卫士通	62,500	1,528,125.00	0.08
326	000027	深圳能源	246,400	1,527,680.00	0.08
327	600699	均胜电子	71,000	1,516,560.00	0.08
328	600808	马钢股份	443,700	1,513,017.00	0.08
329	000898	鞍钢股份	397,220	1,505,463.80	0.08
330	000932	华菱钢铁	315,160	1,503,313.20	0.08
331	600549	厦门钨业	104,900	1,501,119.00	0.08
332	300251	光线传媒	219,900	1,495,320.00	0.08
333	002563	森马服饰	134,700	1,489,782.00	0.08
334	300296	利亚德	189,900	1,486,917.00	0.08

335	600820	隧道股份	233,900	1,475,909.00	0.08
336	002773	康弘药业	44,790	1,474,486.80	0.08
337	600160	巨化股份	205,200	1,458,972.00	0.08
338	002340	格林美	309,700	1,458,687.00	0.08
339	002294	信立泰	65,000	1,454,700.00	0.08
340	600392	盛和资源	130,940	1,448,196.40	0.08
341	000046	泛海控股	258,900	1,444,662.00	0.08
342	000623	吉林敖东	87,634	1,436,321.26	0.08
343	600598	北大荒	132,900	1,426,017.00	0.08
344	000983	西山煤电	234,700	1,422,282.00	0.08
345	002812	恩捷股份	30,400	1,421,200.00	0.08
346	601598	中国外运	296,200	1,418,798.00	0.08
347	600967	内蒙一机	126,200	1,413,440.00	0.08
348	000998	隆平高科	97,500	1,411,800.00	0.08
349	000883	湖北能源	324,200	1,407,028.00	0.08
350	000729	燕京啤酒	211,000	1,401,040.00	0.08
351	600466	蓝光发展	224,500	1,396,390.00	0.08
352	000960	锡业股份	124,600	1,391,782.00	0.07
353	300072	三聚环保	175,100	1,388,543.00	0.07
354	600201	生物股份	87,300	1,369,737.00	0.07
355	601333	广深铁路	420,700	1,358,861.00	0.07
356	600863	内蒙华电	430,600	1,352,084.00	0.07
357	601958	金钼股份	200,800	1,345,360.00	0.07
358	600885	宏发股份	55,340	1,344,762.00	0.07
359	600521	华海药业	94,266	1,329,150.60	0.07
360	600026	中远海能	204,400	1,326,556.00	0.07
361	000997	新大陆	78,300	1,322,487.00	0.07
362	000778	新兴铸管	297,500	1,320,900.00	0.07
363	600258	首旅酒店	73,400	1,319,732.00	0.07
364	002078	太阳纸业	193,600	1,318,416.00	0.07
365	600511	国药股份	57,000	1,309,290.00	0.07
366	600486	扬农化工	23,900	1,307,330.00	0.07
367	600373	中文传媒	102,289	1,284,749.84	0.07
368	002572	索菲亚	69,200	1,284,352.00	0.07
369	002217	合力泰	232,100	1,283,513.00	0.07
370	603883	老百姓	21,900	1,280,712.00	0.07
371	600572	康恩贝	199,200	1,274,880.00	0.07
372	002092	中泰化学	159,400	1,268,824.00	0.07
373	600380	健康元	145,200	1,255,980.00	0.07

374	600879	航天电子	203,384	1,252,845.44	0.07
375	000826	启迪桑德	106,200	1,252,098.00	0.07
376	000060	中金岭南	266,900	1,251,761.00	0.07
377	600446	金证股份	63,600	1,249,104.00	0.07
378	603077	和邦生物	657,300	1,248,870.00	0.07
379	002152	广电运通	181,100	1,240,535.00	0.07
380	000559	万向钱潮	206,100	1,232,478.00	0.07
381	000039	中集集团	115,320	1,231,617.60	0.07
382	600273	嘉化能源	106,300	1,228,828.00	0.07
383	601880	大连港	576,000	1,226,880.00	0.07
384	600648	外高桥	57,900	1,214,742.00	0.07
385	601000	唐山港	441,100	1,213,025.00	0.07
386	000513	丽珠集团	36,400	1,209,572.00	0.06
387	000028	国药一致	28,596	1,196,170.68	0.06
388	002038	双鹭药业	50,700	1,194,492.00	0.06
389	600782	新钢股份	237,300	1,186,500.00	0.06
390	000830	鲁西化工	108,900	1,184,832.00	0.06
391	002085	万丰奥威	162,611	1,183,808.08	0.06
392	000839	中信国安	291,900	1,173,438.00	0.06
393	600500	中化国际	156,200	1,166,814.00	0.06
394	000581	威孚高科	62,500	1,160,000.00	0.06
395	600643	爱建集团	120,800	1,157,264.00	0.06
396	600282	南钢股份	330,100	1,155,350.00	0.06
397	000738	航发控制	86,159	1,154,530.60	0.06
398	002583	海能达	137,600	1,154,464.00	0.06
399	600567	山鹰纸业	342,500	1,154,225.00	0.06
400	000503	国新健康	67,100	1,151,436.00	0.06
401	601168	西部矿业	177,500	1,132,450.00	0.06
402	002074	国轩高科	85,400	1,119,594.00	0.06
403	002174	游族网络	66,300	1,119,144.00	0.06
404	002019	亿帆医药	90,800	1,112,300.00	0.06
405	600056	中国医药	80,200	1,081,898.00	0.06
406	600260	凯乐科技	53,100	1,060,938.00	0.06
407	600582	天地科技	306,800	1,058,460.00	0.06
408	600777	新潮能源	507,000	1,054,560.00	0.06
409	002603	以岭药业	90,800	1,051,464.00	0.06
410	600348	阳泉煤业	179,000	1,039,990.00	0.06
411	002424	贵州百灵	104,700	1,034,436.00	0.06
412	000990	诚志股份	62,500	1,025,625.00	0.06

413	000598	兴蓉环境	224,700	1,022,385.00	0.05
414	000937	冀中能源	264,200	1,019,812.00	0.05
415	600754	锦江股份	41,200	1,015,168.00	0.05
416	000681	视觉中国	52,000	1,007,760.00	0.05
417	600277	亿利洁能	204,600	996,402.00	0.05
418	600835	上海机电	60,000	996,000.00	0.05
419	600062	华润双鹤	78,300	987,363.00	0.05
420	002640	跨境通	115,900	965,447.00	0.05
421	600717	天津港	149,280	958,377.60	0.05
422	002745	木林森	79,900	936,428.00	0.05
423	600787	中储股份	163,400	936,282.00	0.05
424	600884	杉杉股份	86,300	919,095.00	0.05
425	000887	中鼎股份	92,000	882,280.00	0.05
426	600409	三友化工	154,800	876,168.00	0.05
427	600291	西水股份	82,200	826,932.00	0.04
428	002221	东华能源	60,734	522,919.74	0.03
429	002470	金正大	121,200	441,168.00	0.02
430	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
431	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
432	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	91,769,085.97	4.93
2	601318	中国平安	74,576,314.17	4.01
3	600036	招商银行	63,623,632.19	3.42
4	601166	兴业银行	34,897,253.51	1.87
5	000858	五粮液	33,757,316.98	1.81
6	600000	浦发银行	30,168,907.88	1.62
7	002415	海康威视	28,959,848.29	1.56
8	000002	万科 A	27,436,756.78	1.47
9	601398	工商银行	25,680,228.00	1.38

10	601288	农业银行	25,003,058.00	1.34
11	600276	恒瑞医药	24,361,476.14	1.31
12	601328	交通银行	22,917,902.00	1.23
13	000001	平安银行	22,406,053.24	1.20
14	601668	中国建筑	22,260,431.80	1.20
15	600030	中信证券	21,457,110.00	1.15
16	600900	长江电力	21,261,179.49	1.14
17	600016	民生银行	21,189,407.00	1.14
18	601601	中国太保	19,132,385.48	1.03
19	600050	中国联通	18,328,452.00	0.98
20	600104	上汽集团	18,057,391.00	0.97

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	357,846,156.26	19.22
2	002555	三七互娱	291,206,472.48	15.64
3	601766	中国中车	65,032,252.87	3.49
4	601186	中国铁建	62,084,209.95	3.33
5	600637	东方明珠	48,854,476.41	2.62
6	600584	长电科技	13,359,712.00	0.72
7	600460	士兰微	11,048,383.00	0.59
8	600519	贵州茅台	7,939,670.98	0.43
9	600036	招商银行	6,985,770.61	0.38
10	601988	中国银行	6,728,205.52	0.36
11	601318	中国平安	6,722,174.80	0.36
12	000858	五粮液	6,391,381.11	0.34
13	000001	平安银行	4,587,706.51	0.25
14	000002	万科 A	3,905,888.97	0.21
15	000050	深天马 A	3,808,931.43	0.20
16	601166	兴业银行	3,716,910.00	0.20
17	600023	浙能电力	3,568,389.00	0.19
18	600000	浦发银行	3,311,599.00	0.18
19	002714	牧原股份	3,293,705.66	0.18
20	002415	海康威视	3,282,140.62	0.18

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	2,202,502,712.36
卖出股票收入（成交）总额	1,114,430,428.86

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 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 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	370,509.34
2	应收证券清算款	9,771,986.96
3	应收股利	-
4	应收利息	5,175.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,147,671.37

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

§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

8.1.1 本基金的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
14,374	134,465.39	957,735,659.00	49.55%	975,069,923.00	50.45%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行股份有限公司—银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起	107,300,000.00	5.55%

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	安邦人寿保险股份有限公司—保守型投资组合	344,677,019.00	17.83%
2	国新投资有限公司	149,397,600.00	7.73%
3	华夏基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	107,666,062.00	5.57%
4	国开金融有限责任公司	46,440,000.00	2.40%
5	招商证券股份有限公司	25,996,800.00	1.35%
6	中信证券股份有限公司	23,143,000.00	1.20%
7	宁波珑琪投资管理合伙企业（有限合伙）	20,000,000.00	1.03%
8	中国石油化工集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	17,557,800.00	0.91%
9	中信证券—“邮银财富·债券”系列理财产品—中信证券邮储银行 2 号定向资产管理合	16,560,400.00	0.86%
10	方正证券股份有限公司	15,771,004.00	0.82%
11	中国工商银行股份有限公司—银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起	107,300,000.00	5.55%

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的情况

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	87,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	213,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,932,805,582.00

§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，本基金托管人未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中泰证券股份 有限公司	3	746,747,316.15	22.55%	695,446.08	25.16%	-
东吴证券股 份有限公司	2	638,467,524.99	19.28%	466,910.67	16.89%	-
国盛证券有 限责任公司	2	491,481,366.07	14.84%	359,421.22	13.00%	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	378,952,686.10	11.44%	352,916.25	12.77%	-
广发证券股 份有限公司	2	324,732,511.97	9.81%	237,479.39	8.59%	-
国信证券股 份有限公司	1	233,837,296.03	7.06%	217,772.04	7.88%	-
中信证券股 份有限公司	1	161,118,948.59	4.87%	150,052.32	5.43%	-
长江证券股 份有限公司	2	147,600,953.87	4.46%	107,940.90	3.91%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	117,927,369.89	3.56%	109,825.23	3.97%	-
兴业证券股 份有限公司	1	40,677,479.60	1.23%	37,882.14	1.37%	-
国海证券股 份有限公司	2	30,200,324.38	0.91%	28,125.57	1.02%	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金	2	-	-	-	-	-

融有限公司						
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

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。

3、本基金合同生效日 2019 年 3 月 19 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司关于增加中信证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 1 月 28 日
2	《银华基金管理股份有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 1 月 31 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国中投证券有限责任公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 2 月 12 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金增加发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 2 月 15 日
5	《银华基金管理股份有限公司关	证券时报及本基金	2019 年 2 月 22 日

	于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金延长募集期限的公告》	管理人网站	
6	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 2 月 26 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加国信证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 2 月 27 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于增加国元证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 3 月 1 日
9	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 3 月 5 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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 3 月 7 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加恒泰证券股份有限公司为银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发售代理机构的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 3 月 9 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 3 月 20 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金最小申购赎回单位的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 18 日
14	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 25 日
15	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金开放日常申	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 25 日

	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 26 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 26 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 29 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金暂不开通赎回业务的提示性公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 11 日
19	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金开放日常赎回业务的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 6 月 13 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告》	证券时报及本基金经理人网站	2019 年 6 月 18 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中国银行股份有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金经理人网站	2019 年 6 月 26 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	2019/03/19-2019/03/13	344,677,019.00	0.00	0.00	344,677,019.00	17.87%
个人	1	2019/03/19-2019/03/13	323,936,000.00	0.00	323,936,000.00	0.00	0.00%
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

1、本基金管理人于 2019 年 4 月 25 日披露了《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购业务的公告》，本基金自 2019 年 4 月 30 日起开放日常申购业务。

2、本基金管理人于 2019 年 4 月 25 日披露了《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告》，本基金自 2019 年 4 月 30 日在上海证券交易所上市交易。

3、本基金管理人于 2019 年 6 月 13 日披露了《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金开放日常赎回业务的公告》，本基金自 2019 年 6 月 17 日起开放日常赎回业务。

备查文件目录

11.3 备查文件目录

- 11.3.1 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
- 11.3.2 《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》
- 11.3.3 《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》
- 11.3.4 《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》
- 11.3.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 11.3.6 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
- 11.3.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

11.4 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。

11.5 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

2019年8月26日