

# 银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
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.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	42
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	52
7.7 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 .....	52
7.8 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 .....	52
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金融衍生品投资明细 .....	52
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华恒生中国企业指数分级证券投资基金		
基金简称	银华恒生国企指数分级（QDII）		
场内简称	恒生中企		
基金主代码	161831		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 4 月 9 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	1,227,717,500.15 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	2014 年 5 月 12 日		
下属分级基金的基金简称:	恒中企 A	恒中企 B	恒生中企
下属分级基金的交易代码:	150175	150176	161831
报告期末下属分级基金的份 额总额	568,668,428.00 份	568,668,428.00 份	90,380,644.15 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争对恒生中国企业指数进行有效跟踪，并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 5% 以内，以实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用复制法，按照成份股在恒生中国企业指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪恒生中国企业指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	人民币/港币汇率×恒生中国企业指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，恒中企 A 份额具有预期低风险、收益相对稳定的特征；

	恒中企 B 份额具有预期高风险、高预期收益的特征。同时，本基金为海外证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、主要市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。
--	---

### 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	李申
	联系电话	jiJinGuanLiRenLianXiDianHua	021-60637102
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	021-60637111
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 号东方广场东方经贸城 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	田国立

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, HONG KONG BRANCH
	中文	摩根大通银行香港分行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070
邮政编码		OH 43240

### 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-2,338,611.28
本期利润	-133,932,880.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0936
本期加权平均净值利润率	-10.07%
本期基金份额净值增长率	-9.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	37,409,926.66
期末可供分配基金份额利润	0.0305
期末基金资产净值	1,125,355,427.97
期末基金份额净值	0.9166
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.22%

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、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

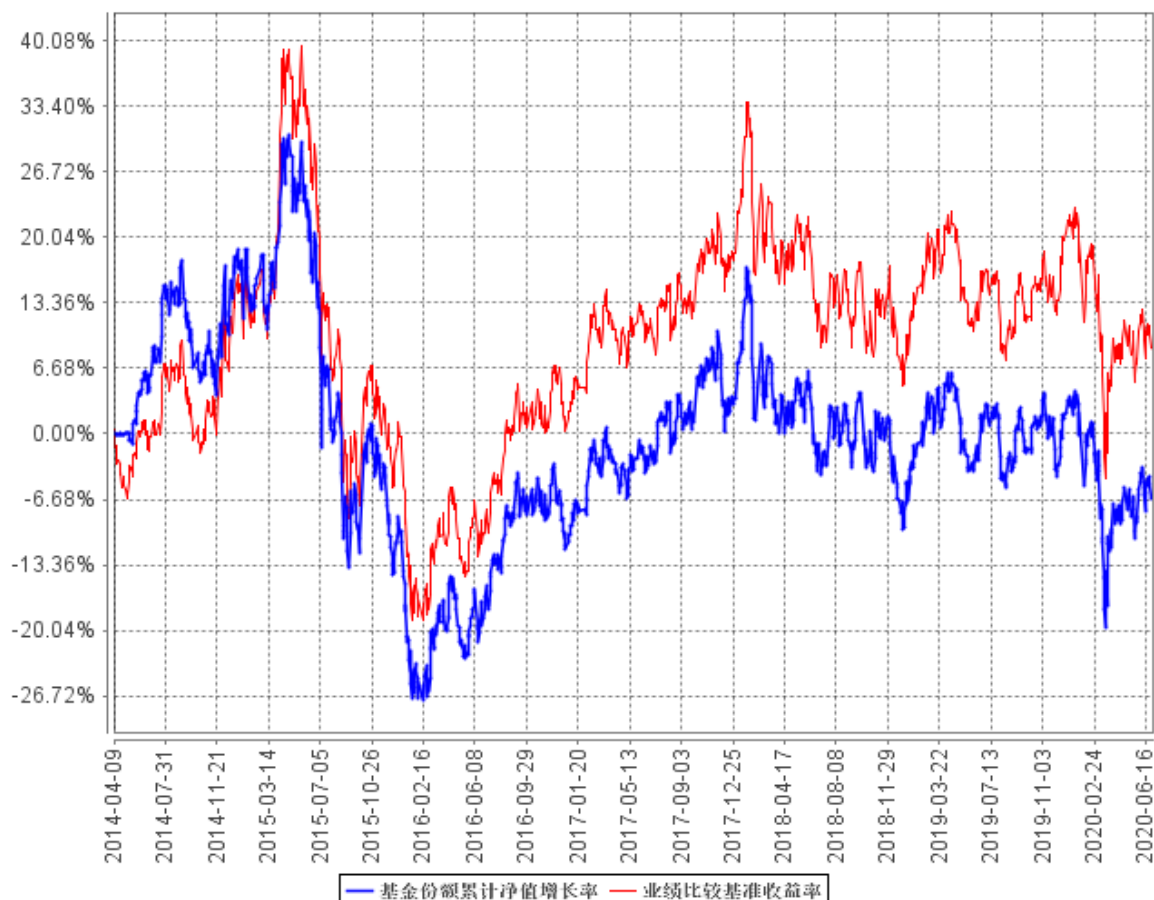
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.31%	1.19%	1.29%	1.15%	1.02%	0.04%
过去三个月	3.47%	1.36%	1.62%	1.32%	1.85%	0.04%
过去六个月	-9.15%	1.84%	-10.29%	1.82%	1.14%	0.02%
过去一年	-5.71%	1.42%	-6.41%	1.40%	0.70%	0.02%
过去三年	3.93%	1.27%	-0.52%	1.27%	4.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.22%	1.32%	8.71%	1.33%	-1.49%	-0.01%

### 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



按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五章的规定：投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## § 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2020年6月30日,本基金管理人管理着130只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华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、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华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、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金。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		
乐育涛先生	本基金的基金经理	2014年4月9日	-	17年	硕士学历。曾就职于 WorldCo 金融服务公司，主要从事自营证券投资工作；曾就职于 Binocular 资产管理公司，主要从事股指期货交易策略研究工作；并曾就职于 Evaluserve 咨询公司，曾任职投资研究部主管。2007 年 4 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任基金经理助理职务，自 2011 年 5 月 11 日起担任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2014 年 4

					月 9 日起兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
李宜璇女士	本基金的基金经理	2018年3月7日	-	6年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014年12月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2017年12月25日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自2018年3月7日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。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。

#### 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》、《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、《银华恒生中国企业指数分级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。

### 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

本基金主要采用组合复制策略以更好地跟踪标的指数恒生国企指数，实现基金投资目标。报告期内，本基金积极采取措施应对大额申赎对跟踪效果带来的影响。

#### 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 0.9166 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.15%，业绩比较基准收益率为-10.29%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为一只投资于香港恒生国企指数的被动投资管理产品，本基金将在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，逐步降低前期产生的跟踪误差，力争投资回报与业绩比较基准保持一致。

### 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**

本基金基金合同存续期内不进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	118,737,052.88	141,612,618.23
结算备付金		24,576,856.21	28,078,121.65
存出保证金		14,782,601.43	8,529,380.67
交易性金融资产	6.4.7.2	945,110,941.52	1,343,416,051.77
其中：股票投资		945,110,941.52	1,343,416,051.77
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		14,438,010.37	26,194,549.09
应收利息	6.4.7.5	1,970.67	30,881.90
应收股利		13,343,997.28	188,100.00
应收申购款		35,034.74	52,201.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,131,026,465.10	1,548,101,904.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,767,771.97	39,069,843.40
应付管理人报酬		966,090.04	1,301,291.05
应付托管费		270,505.21	364,361.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	394,093.61	198,857.61

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	272,576.30	519,015.27
负债合计		5,671,037.13	41,453,368.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,087,945,501.31	1,323,375,421.49
未分配利润	6.4.7.10	37,409,926.66	183,273,114.11
所有者权益合计		1,125,355,427.97	1,506,648,535.60
负债和所有者权益总计		1,131,026,465.10	1,548,101,904.40

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，恒生中企分级份额净值人民币 0.9166 元，恒中企 A 份额净值人民币 1.0288 元，恒中企 B 份额净值人民币 0.8044 元；基金份额总额 1,227,717,500.15 份，其中，恒生中企分级份额总额 90,380,644.15 份，恒中企 A 份额总额 568,668,428.00 份，恒中企 B 份额总额 568,668,428.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-123,852,595.04	261,612,954.03
1.利息收入		254,771.45	432,923.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	254,771.45	353,189.81
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	79,733.75
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,091,375.79	146,783,437.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,706,534.09	97,275,018.00
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-8,546,953.76	14,456,524.87
股利收益	6.4.7.17	20,344,863.64	35,051,894.28

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-131,594,269.65	115,638,488.55
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		1,982,382.28	-2,116,058.62
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	413,145.09	874,163.39
<b>减:二、费用</b>		10,080,285.89	19,368,795.67
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,625,027.55	11,875,129.11
2.托管费	6.4.10.2.2	1,855,007.68	3,325,036.18
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.7.20	1,161,222.71	3,445,160.17
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	75,098.71
7.其他费用	6.4.7.21	439,027.95	648,371.50
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-133,932,880.93	242,244,158.36
减:所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-133,932,880.93	242,244,158.36

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华恒生中国企业指数分级证券投资基金

本报告期:2020年1月1日至2020年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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)	1,323,375,421.49	183,273,114.11	1,506,648,535.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-133,932,880.93	-133,932,880.93
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)	-235,429,920.18	-11,930,306.52	-247,360,226.70
其中:1.基金申购款	84,923,681.68	798,468.89	85,722,150.57
2.基金赎回款	-320,353,601.86	-12,728,775.41	-333,082,377.27

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）	1,087,945,501.31	37,409,926.66	1,125,355,427.97
项目	上年度可比期间 2019年1月1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）	2,769,616,438.26	12,470,705.84	2,782,087,144.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	242,244,158.36	242,244,158.36
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）	-1,064,230,775.99	-89,012,871.77	-1,153,243,647.76
其中：1.基金申购款	5,213,719.38	385,650.29	5,599,369.67
2.基金赎回款	-1,069,444,495.37	-89,398,522.06	-1,158,843,017.43
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）	1,705,385,662.27	165,701,992.43	1,871,087,654.70

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：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
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

银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（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[2013]1433号《关于核准银华恒生中国企业指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于2014年3月10日至2014

年 4 月 2 日向社会公开募集，基金合同于 2014 年 4 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 303,487,507.99 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外托管人为摩根大通银行香港分行。

银华恒生国企指数分级（QDII）的基金份额包括银华恒生国企指数分级（QDII）的基础份额（即“恒生中企份额”）、银华恒生国企指数分级（QDII）的稳健收益类份额（即“恒中企 A 份额”）与银华恒生国企指数分级（QDII）的积极收益类份额（即“恒中企 B 份额”）。（注：根据《关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金变更子份额场内简称的公告》，自 2015 年 2 月 4 日起，本基金稳健收益类份额的场内简称由“银华 H 股 A”更名为“H 股 A”，本基金积极收益类份额的场内简称由“银华 H 股 B”更名为“H 股 B”。根据《关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金变更基础份额场内简称的公告》，自 2015 年 4 月 10 日起，本基金基础份额的场内简称由“银华 H 股”更名为“H 股分级”。根据《银华基金管理股份有限公司关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金变更场内简称的公告》，自 2018 年 4 月 25 日起，本基金基础份额的场内简称由“H 股分级”更名为“恒生中企”，本基金稳健收益类基金份额的场内简称由“H 股 A”更名为“恒中企 A”，本基金积极收益类份额的场内简称由“H 股 B”更名为“恒中企 B”。）恒生中企份额设置单独的基金代码，可以进行场内与场外的申购和赎回，及上市交易。恒中企 A 份额与恒中企 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

在恒中企 A 份额、恒生中企份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将按照基金合同的规定进行基金的定期份额折算。恒中企 A 份额和恒中企 B 份额按照基金合同规定的基金份额的分类与净值计算规则进行净值计算，对恒中企 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份恒生中企份额将按 1 份恒中企 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，恒中企 A 份额和恒中企 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于恒中企 A 份额期末的约定应得收益，即恒中企 A 份额每个定期折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出 1.0000 元部分，将折算为场内恒生中企份额分配给恒中企 A 份额持有人。恒生中企份额持有人持有的每 2 份恒生中企份额将按 1 份恒中企 A 份额获得新增恒生中企份额的分配。持有场外恒生中企份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外恒生中企份额的分配；持有场内恒生中企份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内恒生中企份额的分配。经过上述份额折算，恒中企 A 份额和恒生中企份额的基金份额净值将相应调整。

除以上定期份额折算外，本基金还将在恒生中企份额的基金份额净值达到 1.5000 元及以上时，分别对恒中企 A 份额、恒中企 B 份额和恒生中企份额进行份额折算，份额折算后本基金将确

保恒中企 A 份额和恒中企 B 份额的比例为 1:1，份额折算后恒中企 A 份额、恒中企 B 份额和恒生中企份额的基金份额净值均调整为 1 元。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF、以及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具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的相关规定）。如果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，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为人民币/港币汇率×恒生中国企业指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。

#### 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》、《公开募集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 3 号《半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〈年度报告和中期报告〉》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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	118,737,052.88
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：	118,737,052.88

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	955,718,483.80	945,110,941.52	-10,607,542.28
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	955,718,483.80	945,110,941.52	-10,607,542.28

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	115,956,217.34	-	-	
HHI2009	115,956,217.34	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	115,956,217.34	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2020 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：HHI2009 买入持仓量 260 手，合约市值人民币 114,151,683.36 元，公允价值变动人民币 -1,804,533.98 元。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,970.67
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	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,970.67

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	394,093.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	394,093.61

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,638.81
应付证券出借违约金	-
预提费用	134,261.40
指数使用费	124,676.09
合计	272,576.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,493,393,889.94	1,323,375,421.49

本期申购	95,834,111.20	84,923,681.68
本期赎回(以“-”号填列)	-361,510,500.99	-320,353,601.86
- 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	1,227,717,500.15	1,087,945,501.31

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) 根据基金合同规定，恒生中企分级份额设置单独的基金代码，可以进行场内与场外的申购和赎回，及上市交易。恒中企 A 份额与恒中企 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。因此上表不再单独披露恒中企 A 份额与恒中企 B 份额的情况。

#### 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
上年度末	50,218,896.13	133,054,217.98	183,273,114.11
本期利润	-2,338,611.28	-131,594,269.65	-133,932,880.93
本期基金份额交易产生的变动数	-3,348,121.98	-8,582,184.54	-11,930,306.52
其中：基金申购款	3,181,519.58	-2,383,050.69	798,468.89
基金赎回款	-6,529,641.56	-6,199,133.85	-12,728,775.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,532,162.87	-7,122,236.21	37,409,926.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	229,357.44
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	25,414.01
其他	-
合计	254,771.45

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	400,768,079.86
减：卖出股票成本总额	407,474,613.95
买卖股票差价收入	-6,706,534.09

**6.4.7.13 基金投资收益**

无。

**6.4.7.14 债券投资收益**

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-8,546,953.76

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,344,863.64
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	20,344,863.64
----	---------------

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-129,730,783.84
——股票投资	-129,730,783.84
——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	-1,863,485.81
——权证投资	-
期货投资	-1,863,485.81
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	-131,594,269.65

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	413,145.09
合计	413,145.09

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,161,222.71
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	1,161,222.71

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上市月费	29,835.26
指数使用费	265,001.07
银行汇划费	39,765.48
合计	439,027.95

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行香港分行（“摩根大通银行”）	基金境外托管人
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
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东北证券	161,460,595.69	29.92%	656,619,815.84	40.44%

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券	129,163.73	24.98%	328,021.34	83.23%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
东北证券	525,305.81	33.76%	525,305.81	17.59%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费



后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,625,027.55	11,875,129.11
其中：支付销售机构的客户维护费	142,781.04	213,503.30

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,855,007.68	3,325,036.18

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.28%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% / \text{当年天数}$$

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

#### 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

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

无。

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

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

恒中企 A				
关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
西南 证券	16,809,950.00	1.37%	16,809,950.00	2.42%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
摩根大通银行	115,016,243.06	-	166,427,733.29	-
中国建设银行	3,720,809.82	229,357.44	27,524,968.38	353,189.81

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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。本基金为指数基金，投资标的具有较高的信用等级，且通过分散化投资可以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商及资产托管机构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。

##### 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财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。由于本基金主要投资于股票和基金，生息资产主要为银行存款，无重大利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	3,310,862.91	-	-	-	-	-	3,310,862.91
应收利息	-	-	-	-	-	1,970.67	1,970.67
应收股利	-	-	-	-	-	13,343,997.28	13,343,997.28
应收申购款	-	-	-	-	-	35,034.74	35,034.74
资产总计	3,310,862.91	-	-	-	-	13,381,002.69	16,691,865.60
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	3,767,771.97	3,767,771.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	966,090.04	966,090.04
应付托管费	-	-	-	-	-	270,505.21	270,505.21
其他负债	-	-	-	-	-	147,900.21	147,900.21
负债总计	-	-	-	-	-	5,152,267.43	5,152,267.43
利率敏感度缺口	3,310,862.91	-	-	-	-	8,228,735.26	11,539,598.17
上年度末 2019年12月31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	110,714,453.29	-	-	-	-	30,898,164.94	141,612,618.23
结算备付金	-	-	-	-	-	28,078,121.65	28,078,121.65
存出保证金	-	-	-	-	-	8,529,380.67	8,529,380.67
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,343,416,051.77	1,343,416,051.77
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,194,549.09	26,194,549.09
应收利息	-	-	-	-	-	30,881.90	30,881.90
应收股利	-	-	-	-	-	188,100.00	188,100.00
应收申购款	-	-	-	-	-	52,201.09	52,201.09
资产总计	110,714,453.29	-	-	-	-	1,437,387,451.11	1,548,101,904.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,069,843.40	39,069,843.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,301,291.05	1,301,291.05
应付托管费	-	-	-	-	-	364,361.47	364,361.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	198,857.61	198,857.61
其他负债	-	-	-	-	-	519,015.27	519,015.27
负债总计	-	-	-	-	-	41,453,368.80	41,453,368.80
利率敏感度缺口	110,714,453.29	-	-	-	-	1,395,934,082.31	1,506,648,535.60

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

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此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 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	115,426,189.97	-	115,426,189.97
结算备付金	-	22,846,793.78	-	22,846,793.78
存出保证金	-	14,782,601.43	-	14,782,601.43
交易性金融资产	-	592,790,659.04	-	592,790,659.04
应收股利	-	3,518,461.20	-	3,518,461.20
应收利息	-	1.10	-	1.10
资产合计	-	749,364,706.52	-	749,364,706.52
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	749,364,706.52	-	749,364,706.52
项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	31,465,240.57	-	31,465,240.57
结算备付金	-	28,078,121.65	-	28,078,121.65
存出保证金	-	8,529,380.67	-	8,529,380.67
交易性金融资产	-	1,343,416,051.77	-	1,343,416,051.77
应收利息	-	1.68	-	1.68
应收证券清算款	-	1,290,386.71	-	1,290,386.71
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	1,412,779,183.05	-	1,412,779,183.05
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	58,951.83	-	58,951.83
其它负债	-	-	-	-
负债合计	-	58,951.83	-	58,951.83
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,412,720,231.22	-	1,412,720,231.22

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	港币 5%	37,468,235.33	70,638,959.15
	港币-5%	-37,468,235.33	-70,638,959.15

注：上表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。本基金的基金管理人通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对恒生国企指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	945,110,941.52	83.98	1,343,416,051.77	89.17

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	945,110,941.52	83.98	1,343,416,051.77	89.17

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变动 5%，且其他市场变量保持不变；		
	根据期末时点基金净资产相对于业绩比较基准的 Beta 系数计算资产变动幅度；		
	Beta 系数是根据本报告期所有交易日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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	5%	56,511,131.05	75,662,521.82
	-5%	-56,511,131.05	-75,662,521.82

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。表格为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	945,110,941.52	83.56
	其中：普通股	945,110,941.52	83.56
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	143,313,909.09	12.67
8	其他各项资产	42,601,614.49	3.77
9	合计	1,131,026,465.10	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	945,110,941.52	83.98
合计	945,110,941.52	83.98

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

2. 本基金本报告期末未持有存托凭证。

3. 自 2015 年 4 月 28 日起，本基金开始通过沪港通机制投资于中国香港股票市场上的恒生中国企业指数成分股、备选股。截至本报告期末，本基金通过沪港通交易机制持有的股票的市值为 352,320,282.48 元，占期末净值 31.31%。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
Health Care	43,018,179.12	3.82
Consumer Staples	31,641,972.65	2.81
Materials	13,231,635.12	1.18
Telecommunication Services	88,851,541.95	7.90
Real-estate	71,389,652.01	6.34
Consumer Discretionary	52,931,514.15	4.70
Industrials	41,085,197.58	3.65
Utilities	40,815,212.12	3.63
Financials	372,386,421.83	33.09
Energy	67,382,568.85	5.99
Information Technology	122,377,046.14	10.87
合计	945,110,941.52	83.98

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2、本基金本报告期末未持有存托凭证。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	CH	268,700.00	122,377,046.14	10.87
2	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)	02318 HKCG	港股通	CH	1,352,000	95,710,243.20	8.50

		团)股份有限公司中国平安保险(集团)股份有限公司						
3	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	中国工商银行股份有限公司	01398 HKCG	港 股 通	CH	16,559,000	71,090,568.91	6.32
4	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	1,371,500	65,520,548.81	5.82
5	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	03988 HKCG	港 股 通	CH	17,892,000	46,905,180.54	4.17
6	CNOOC Limited	中国海洋石油	00883 HKCG	港 股 通	CH	4,046,000	31,857,608.43	2.83
7	China Merchants Bank Co.,Ltd.	招商银行股份有限公司	03968 HKCG	港 股 通	CH	871,000	28,363,362.46	2.52
8	China Life Insurance Co. Ltd.	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	1,671,000	23,811,188.54	2.12

9	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国生物制药	1177 HK	香港证券交易所	CH	1,629,000	21,724,708.90	1.93
10	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	CH	710,000	19,034,719.44	1.69
11	Sunny Optical Technology (Group) Company Ltd.	舜宇光学科技	02382 HKCG	港股通	CH	161,600	18,303,876.10	1.63
12	Agricultural Bank Of China Limited	中国农业银行股份有限公司	01288 HKCG	港股通	CH	6,229,000	17,752,231.41	1.58
13	Sunac China Holdings Ltd	融创中国	1918 HK	香港证券交易所	CH	574,000	17,014,007.47	1.51
14	CSPC Pharmaceutical Group LTD.	石药集团	1093 HK	香港证券交易所	CH	1,226,400	16,400,354.83	1.46
15	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	2319 HK	香港证券交易所	CH	599,000	16,195,656.58	1.44

				所				
16	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	CH	5,392,000	15,908,617.19	1.41
17	SHENZHOU international group	申洲国际	2313 HK	香港证券交易所	CH	186,300	15,894,239.64	1.41
18	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港证券交易所	CH	242,000	15,119,989.63	1.34
19	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	2007 HK	香港证券交易所	CH	1,695,000	14,739,633.22	1.31
20	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	香港证券交易所	CH	358,000	14,126,897.66	1.26
21	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源	2688 HK	香港证券交易所	CH	174,800	13,923,164.01	1.24
22	Geely Automobile	吉利	175 HK	香	CH	1,226,000	13,662,504.77	1.21

	Holdings Limited	汽车		港 证 券 交 易 所				
23	Anhui Conch Cement Company Limited	安徽 海螺 集团 有限 责任 公司	00914 HKCG	港 股 通	CH	277,500	13,231,635.12	1.18
24	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	龙湖 集团	960 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	392,500	13,211,653.62	1.17
25	CHINA TOWER CORP LTD-H	中国 铁塔	788 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	9,806,000	12,271,353.92	1.09
26	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国 太保	2601 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	619,600	11,715,525.68	1.04
27	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺 创业	586 HK	香 港 证 券 交 易 所	CH	380,000	11,350,405.44	1.01
28	PetroChina Company Limited	中国 石油 天然 气集	00857 HKCG	港 股 通	CH	4,772,000	11,202,464.70	1.00

		团公司						
29	CITIC LTD	中信股份	267 HK	香港证券交易所	CH	1,649,000	10,965,591.44	0.97
30	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气	384 HK	香港证券交易所	CH	461,800	10,081,655.55	0.90
31	Picc Property And Casualty Company Limited	中国人民财产保险股份有限公司	02328 HKCG	港股通	CH	1,597,000	9,321,499.92	0.83
32	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	邮储银行	1658 HK	香港证券交易所	CH	2,215,000	9,003,549.72	0.80
33	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港证券交易所	CH	158,500	8,788,160.57	0.78
34	Bank Of Communications Co.,Ltd.	交通银行股份有限公司	03328 HKCG	港股通	CH	1,965,000	8,579,667.89	0.76
35	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	1088 HK	香港	CH	760,000	8,413,878.53	0.75

				证券交易所				
36	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	270 HK	香港证券交易所	CH	674,000	8,188,258.85	0.73
37	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂集团	813 HK	香港证券交易所	CH	271,000	8,119,385.47	0.72
38	BYD Co. Ltd.	比亚迪股份有限公司	1211 HK	香港证券交易所	CH	142,500	7,790,387.22	0.69
39	CHINA VANKE CO LTD	万科企业股份有限公司	2202 HK	香港证券交易所	CH	330,200	7,389,638.26	0.66
40	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	民生银行	1988 HK	香港证券交易所	CH	1,472,400	7,155,128.98	0.64
41	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	华润燃气	1193 HK	香港证券	CH	198,000	6,827,507.28	0.61



				交易所				
42	Want Want China Holdings Ltd	中国旺旺	151 HK	香港证券交易所	CH	1,246,000	6,658,155.50	0.59
43	China CITIC Bank Corporation Ltd.	中信银行股份有限公司	998 HK	香港证券交易所	CH	2,133,000	6,585,482.22	0.59
44	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	CH	439,500	5,885,357.86	0.52
45	China Telecom Corporation Ltd.	中国电信股份有限公司	728 HK	香港证券交易所	CH	2,942,000	5,831,528.84	0.52
46	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	762 HK	香港证券交易所	CH	1,366,000	5,228,110.38	0.46
47	Fosun International Ltd	复兴国际	656 HK	香港证券交易所	CH	567,000	5,106,695.93	0.45

				所				
48	Sinopharm Group Co. Ltd.	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港证券交易所	CH	270,000	4,893,115.39	0.43
49	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太平	966 HK	香港证券交易所	CH	360,000	4,084,172.93	0.36
50	CHINA EVERBRIGHT WATER LTD	中国光大水务	1857 HK	香港证券交易所	CH	1,651,000	1,794,626.43	0.16

注：1、证券代码采用当地市场代码。

2、本基金本报告期末未持有存托凭证。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	27,434,462.28	1.82
2	SUNNY OPTICAL	2382 HK	17,905,150.48	1.19
3	China Mengniu Dairy Co Ltd	2319 HK	17,091,525.84	1.13
4	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	14,140,014.05	0.94
5	Shimao Property Holdings Ltd	813 HK	8,423,061.89	0.56
6	MINSHENG BANK	1988 HK	8,156,700.07	0.54
7	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	6,128,781.24	0.41
8	ICBC	1398 HK	5,881,930.97	0.39

9	China Unicom Hong Kong Ltd	762 HK	5,656,779.59	0.38
10	CHINA COMM CONS	1800 HK	4,866,084.48	0.32
11	NCI	1336 HK	4,623,977.02	0.31
12	Bank of China Ltd	3988 HK	4,431,626.06	0.29
13	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	4,336,323.84	0.29
14	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	2,907,343.62	0.19
15	CNOOC Ltd	883 HK	2,494,785.65	0.17
16	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	1,276,804.18	0.08
17	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,171,855.05	0.08
18	PICC P&C	2328 HK	788,219.06	0.05
19	Bank of Communications Co Ltd	3328 HK	620,644.97	0.04
20	Anhui Conch Cement Co Ltd	914 HK	564,217.20	0.04

注：1、以上权益投资所在证券市场为香港，所属国家为中国。

2、“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。

### 7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	76,344,609.27	5.07
2	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	30,737,285.38	2.04
3	ICBC	1398 HK	25,141,179.12	1.67
4	China Mobile Ltd	941 HK	22,181,579.01	1.47
5	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	16,665,250.90	1.11
6	Bank of China Ltd	3988 HK	16,303,079.21	1.08
7	CNOOC Ltd	883 HK	11,039,979.08	0.73
8	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	10,860,722.44	0.72
9	NCI	1336 HK	10,502,733.31	0.70
10	CHINA COMM CONS	1800 HK	10,425,611.42	0.69
11	MINSHENG BANK	1988 HK	10,259,297.20	0.68
12	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	9,559,439.68	0.63
13	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	7,818,767.67	0.52
14	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	7,619,777.58	0.51
15	Agricultural Bank of China	1288 HK	5,898,586.85	0.39

	Ltd			
16	SINOPEC CORP	386 HK	5,671,969.36	0.38
17	SUNNY OPTICAL	2382 HK	5,392,894.29	0.36
18	SHENZHOU INTL	2313 HK	5,139,629.98	0.34
19	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	5,097,968.77	0.34
20	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1093 HK	5,059,599.13	0.34

注：1、以上权益投资所在证券市场为香港，所属国家为中国。

2、“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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	138,900,287.54
卖出收入（成交）总额	400,768,079.86

注：权益投资的“买入成本（成交）总额”和“卖出收入（成交）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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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

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金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	其他衍生工具_股指期货	HHI2009_D	115,956,217.34	10.30

注：本基金本报告期末仅持有 1 只金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 7.11.3 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	14,782,601.43
2	应收证券清算款	14,438,010.37
3	应收股利	13,343,997.28
4	应收利息	1,970.67
5	应收申购款	35,034.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,601,614.49

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
恒中企 A	690	824,157.14	491,386,251.00	86.41%	77,282,177.00	13.59%
恒中企 B	8,798	64,636.10	51,870,447.00	9.12%	516,797,981.00	90.88%
恒生中企	6,368	14,192.94	22,564,334.07	24.97%	67,816,310.08	75.03%
合计	15,856	77,429.21	565,821,032.07	46.09%	661,896,468.08	53.91%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

恒中企 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	159,293,698.00	28.01%
2	汇添富基金—上海银行—晋商银行股份有限公司	72,037,350.00	12.67%
3	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	65,778,379.00	11.57%
4	工银瑞信基金—中国财产再保险有限责任公司—自有资金—中国财产再保险有限责任公司委托工银瑞信基金配置型债券投资组合	49,238,645.00	8.66%
5	汇添富基金—南京银行—汇添富旗舰 FOF19 号集合资产管理计划	18,225,407.00	3.20%
6	西南证券股份有限公司	16,809,950.00	2.96%
7	鹏华基金—中信证券股份有限公司—鹏华基金—多资产绝对收益 1 号单一资产管理计划	15,885,537.00	2.79%
8	东证资管平安银行龙江银行定向资产管理计划	15,000,000.00	2.64%
9	鹏华基金—交通银行北京分行—交	12,383,721.00	2.18%

	通银行股份有限公司		
10	中国国际金融股份有限公司	10,038,018.00	1.77%

## 恒中企 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	第一创业证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	21,154,409.00	3.72%
2	上海恺利投资管理有限公司—恺利价值1号私募证券投资基金	19,361,581.00	3.40%
3	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	17,278,032.00	3.04%
4	张美芳	13,853,639.00	2.44%
5	宋伟铭	12,882,757.00	2.27%
6	刘加	10,788,723.00	1.90%
7	国泰君安证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	10,193,613.00	1.79%
8	何守英	8,063,696.00	1.42%
9	吉烈钧	8,000,000.00	1.41%
10	张伟权	7,163,291.00	1.26%

## 恒生中企

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	6,318,201.00	13.01%
2	南京盛泉恒元投资有限公司—盛泉恒元多策略量化对冲1号基金	6,011,400.00	12.38%
3	兴业国际信托有限公司—富直2号量化对冲集合资金信托计划	3,000,000.00	6.18%
4	中意人寿保险有限公司	2,409,034.00	4.96%
5	余晓敏	2,129,524.00	4.38%
6	任文杰	1,839,530.00	3.79%
7	周绍勋	1,214,206.00	2.50%
8	汇添富基金—上海银行—晋商银行股份有限公司	1,138,150.00	2.34%
9	郑雯雯	1,000,000.00	2.06%
10	何青	964,002.00	1.98%

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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	恒中企 A	0.00	0.00%

持有本基金	恒中企 B	0.00	0.00%
	恒生中企	302,313.98	0.33%
	合计	302,313.98	0.02%

对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

#### 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

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

项目	恒中企 A	恒中企 B	恒生中企
基金合同生效日（2014年4月9日）基金份额总额	-	-	303,487,507.99
本报告期期初基金份额总额	693,302,864.00	693,302,864.00	106,788,161.94
本报告期基金总申购份额	-	-	95,834,111.20
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	361,510,500.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-124,634,436.00	-124,634,436.00	249,268,872.00
本报告期期末基金份额总额	568,668,428.00	568,668,428.00	90,380,644.15

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额后的调整份额。

## § 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	-	161,460,595.69	29.92%	129,163.73	24.98%	-
CLSA	-	58,556,871.42	10.85%	70,268.27	13.59%	-
GFSE	-	87,998,685.78	16.31%	87,998.73	17.02%	-
天风证券股份有限公司	-	82,577,452.83	15.30%	66,072.27	12.78%	-
EBS	-	50,047,304.55	9.27%	50,047.31	9.68%	-

China Merchants	-	35,594,554.97	6.60%	35,594.57	6.88%	-
BOCI	-	26,052,174.92	4.83%	39,078.23	7.56%	-
BISH	-	24,557,230.73	4.55%	19,645.78	3.80%	-
SWS	-	12,816,642.35	2.37%	19,224.94	3.72%	-

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、基金成交总额不含非上市(场外)基金的申购和赎回金额。

4、本基金本报告期未通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
GFSE	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
EBS	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI	-	-	-	-	-	-	-	-
BISH	-	-	-	-	-	-	-	-
SWS	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 1 月 18 日
2	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 18 日
3	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 20 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的提示性公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 31 日
5	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停场内大额申购业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 16 日
6	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
7	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
8	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金调整非直销销售机构场外大额申购（含定期定额投资）业务限额并暂停场内份额分拆业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
9	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
10	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
11	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
12	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 23 日
13	《银华基金管理股份有限公司关	四大证券报、中国证	2020 年 3 月 23 日

	于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	
14	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
15	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复赎回、场外申购（含定期定额投资）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 31 日
16	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复赎回、场外申购（含定期定额投资）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 8 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 18 日
18	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 18 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过平安证券股份有限公司办理场外定期定额投资起始金额的公告》	上海证券报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
20	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 22 日
21	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
22	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复赎回、场外申购（含定期定额投资）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 23 日
23	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 5 月 23 日
24	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 5 月 23 日
25	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复赎回、场外	证券时报、中国证监会基金电子披露网	2020 年 6 月 18 日

	申购（含定期定额投资）业务的公告》	站及本基金管理人网站	
26	《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停及恢复赎回、场外申购（含定期定额投资）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 6 月 30 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

本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2020 年 3 月 16 日披露了《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停场内大额申购业务的公告》，自 2020 年 3 月 16 日（含 2020 年 3 月 16 日）起暂停办理银华恒生中国企业指数分级证券投资基金 10 元以上的场内大额申购业务。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 17 日披露了《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》，自 2020 年 3 月 17 日（含 2020 年 3 月 17 日）起暂停银华恒生中国企业指数分级证券投资基金的场内申购业务。

3、本基金管理人于 2020 年 3 月 23 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

4、本基金管理人于 2020 年 3 月 23 日披露了《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金调整非直销销售机构场外大额申购（含定期定额投资）业务限额并暂停场内份额分拆业务的公告》，自 2020 年 3 月 23 日（含 2020 年 3 月 23 日）起单日每个基金账户通过场外非直销销售机构累计申购本基金合计金额不超过 1000 元调整至 10 元，自 2020 年 3 月 24 日（含 2020 年 3 月 24 日）起暂停办理本基金基础份额的场内分拆业务。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华恒生中国企业指数分级证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.4 《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2020 年 8 月 28 日