

# 银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
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 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 .....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	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 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
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情况 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	69
12.3 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	MSCI 中国
场内简称	MSCI 中国
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	192,805,582.00 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

注：本基金的扩位证券简称为：MSCI 中国 ETF

### 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 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	46,234,416.13
本期利润	23,935,575.27
加权平均基金份额本期利润	0.1198
本期加权平均净值利润率	7.95%
本期基金份额净值增长率	7.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	111,334,179.57
期末可供分配基金份额利润	0.5774
期末基金资产净值	304,139,761.57
期末基金份额净值	1.5774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	57.74%

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。

## 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	0.79%	0.82%	-0.55%	0.84%	1.34%	-0.02%
过去三个月	9.96%	0.96%	6.84%	0.98%	3.12%	-0.02%
过去六个月	7.16%	1.30%	3.38%	1.32%	3.78%	-0.02%
过去一年	40.60%	1.33%	28.40%	1.33%	12.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	57.74%	1.29%	44.50%	1.31%	13.24%	-0.02%

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

MSCI 中国累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 149 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 指数证券投资基金 (LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、银华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、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华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、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华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 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基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华长江经济带主题债券型证券投资基金、

银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。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		
周鹏生	本基金的基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	12.5 年	硕士学位。毕业于中国人民大学。2008 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职，自 2011 年 9 月 26 日起至 2014 年 1 月 6 日期间担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2012 年 8 月 23 日至 2020 年 11 月 26 日兼任上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2012 年 8 月 29 日至 2021 年 1 月 7 日兼任银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2013 年 5 月 22 日至 2016 年 4 月 25 日兼任银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金经理，自 2014 年 1 月 7 日至 2018 年 3 月 7 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金（由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型）基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 3 月 7 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2018 年 12 月 26 日兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11

					月9日至2018年12月26日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自2018年1月18日至2021年6月18日兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理,自2018年10月22日起兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2018年11月15日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。
刘文魁先生	本基金的基金经理助理	2019年8月8日	-	7年	硕士学位。曾就职于艾派迪财团、佛罗里达大学商学院、华夏基金管理有限公司。2015年5月加入银华基金,历任量化投资部量化研究员,现任基金经理助理。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	-	9.5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。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2021年4月19日	-	8年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013年7月加入银华基金,历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员,现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，伴随疫苗产量的逐步提高，接种比例的不断上升，新冠疫情的阴影正在全球范围内逐渐减弱。国内方面，春节假期和五一假期的人口流动均未产生明显的疫情反复，疫情的防控依旧维持在一个良好的水平；国外方面，尽管部分国家和地区的疫情控制还没有达到理想的水平，甚至出现了变异病毒等新情况，但整体上的免疫覆盖度仍处于持续上升中。在此背景下，全球经济复苏的预期有所上升，这在利率、贵金属等资产价格的波动上有所反应。这种波动也反过来对权益市场的估值产生了一定的影响。A 股市场在上半年中波动加大，且风格轮动明显：消费、金融等行业有所调整，而周期资源类行业估值提升。

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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5774 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.16%，业绩比较基准收益率为 3.38%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，全球疫情的消退和经济的复苏已经形成明显的趋势，局部的反复无法阻挡这一整体趋势。从全球范围来看，消费需求的复苏、刺激政策的退出和货币政策的正常化都将是接下来一段时期的主基调。在这一背景下，A 股市场仍将持续出现机会。我们需要关注的风险点在于国际摩擦等黑天鹅事件。整体来说，我们对 2021 年下半年的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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,481,525.69	6,360,723.47
结算备付金		427,575.06	639,631.24
存出保证金		1,199,162.83	90,775.27
交易性金融资产	6.4.7.2	290,975,404.25	334,392,157.85
其中：股票投资		290,975,404.25	334,392,157.85
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		372,241.78	1,982,340.43
应收利息	6.4.7.5	1,234.46	1,003.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	108,234.96	-
资产总计		304,565,379.03	343,466,631.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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		559.00	5,328,409.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		124,077.13	147,035.00
应付托管费		24,815.43	29,407.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	71,726.61	216,017.59
应交税费		1,096.07	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,343.22	941,861.58
负债合计		425,617.46	6,662,730.40
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	192,805,582.00	228,805,582.00
未分配利润	6.4.7.10	111,334,179.57	107,998,319.23
所有者权益合计		304,139,761.57	336,803,901.23
负债和所有者权益总计		304,565,379.03	343,466,631.63

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5774 元，基金份额总额 192,805,582.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年



		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		25,514,240.47	58,300,237.55
1. 利息收入		15,583.69	41,021.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,583.69	40,938.03
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		-	83.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		47,541,943.80	69,995,326.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,347,503.63	65,279,780.22
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		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	206,621.36	-
股利收益	6.4.7.16	1,987,818.81	4,715,546.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-22,298,840.86	-13,439,479.28
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	255,553.84	1,703,368.29
减：二、费用		1,578,665.20	4,426,355.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	749,038.87	2,297,492.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	149,807.81	459,498.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	479,529.88	1,314,691.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		743.83	0.31
7. 其他费用	6.4.7.20	199,544.81	354,672.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,935,575.27	53,873,882.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,935,575.27	53,873,882.14

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	228,805,582.00	107,998,319.23	336,803,901.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,935,575.27	23,935,575.27
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）	-36,000,000.00	-20,599,714.93	-56,599,714.93
其中：1. 基金申购款	93,000,000.00	46,279,887.92	139,279,887.92
2. 基金赎回款	-129,000,000.00	-66,879,602.85	-195,879,602.85
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）	192,805,582.00	111,334,179.57	304,139,761.57
项目	上年度可比期间 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）	1,353,805,582.00	62,787,254.21	1,416,592,836.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,873,882.14	53,873,882.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-897,000,000.00	-60,958,365.15	-957,958,365.15

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	204,000,000.00	-1,030,458.12	202,969,541.88
2. 基金赎回款	-1,101,000,000.00	-59,927,907.03	-1,160,927,907.03
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)	456,805,582.00	55,702,771.20	512,508,353.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金财产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债

券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股人民币指数,英文全称为:MSCI China A RMB Index,指数代码为:718711。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增

值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 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, 其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税;

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,481,525.69
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	11,481,525.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	258,476,053.19	290,975,404.25	32,499,351.06
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	258,476,053.19	290,975,404.25	32,499,351.06

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	7,410,240.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,410,240.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,410,240.00	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于2021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：IF2107 买入持仓量4手，合约市值人民币6,229,440.00元，公允价值变动人民币135,360.00元；IC2107 买入持仓量1手，合约市值人民币1,353,440.00元，公允价值变动人民币37,280.00元

#### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,038.38

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	180.48
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	15.60
合计	1,234.46

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	108,234.96
合计	108,234.96

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	71,726.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	71,726.61

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	119,040.66
合计	203,343.22

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	228,805,582.00	228,805,582.00
本期申购	93,000,000.00	93,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-129,000,000.00	-129,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	192,805,582.00	192,805,582.00

注：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。

#### 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	114,893,060.89	-6,894,741.66	107,998,319.23
本期利润	46,234,416.13	-22,298,840.86	23,935,575.27
本期基金份额交易产生的变动数	-21,101,893.19	502,178.26	-20,599,714.93
其中：基金申购款	57,724,123.87	-11,444,235.95	46,279,887.92
基金赎回款	-78,826,017.06	11,946,414.21	-66,879,602.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,025,583.83	-28,691,404.26	111,334,179.57

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	10,421.02	
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	4,777.61	
其他	385.06	
合计	15,583.69	

#### 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	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,484,523.07	
股票投资收益——赎回差价收入	11,862,980.56	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	45,347,503.63	



## 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	171,105,616.94
减：卖出股票成本总额	137,621,093.87
买卖股票差价收入	33,484,523.07

## 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	195,879,602.85
减：现金支付赎回款总额	89,849,079.85
减：赎回股票成本总额	94,167,542.44
赎回差价收入	11,862,980.56

## 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 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

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.2 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	206,621.36

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,987,818.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,987,818.81

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-22,471,480.86
股票投资	-22,471,480.86
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	172,640.00
权证投资	-
期货投资	172,640.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-22,298,840.86

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	255,553.84
合计	255,553.84

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	479,529.88
银行间市场交易费用	-
合计	479,529.88

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	372.00
指数使用费	73,105.21
其他	41,765.04
合计	199,544.81

## 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 2021 年 6 月 17 日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华国际资本管理有限公司增加注册资本的公告》，银华基金管理股份有限公司（以下简称“母公司”）已完成对银华国际资本管理有限公司（以下简称“香港子公司”）的增资工作，母公司向香港子公司增加注册资本金共港币 7,000 万元。增资完成后，母公司维持持股比例 100%，共持股 1 亿股，香港子公司注册资本为 1 亿元港币。

## 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
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
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（以下简称“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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	749,038.87	2,297,492.40
其中：支付销售机构的客户维护费	11,703.08	32,662.02

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,807.81	459,498.48

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 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**

注：无。

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

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
西南证券	14,584.00	0.01	14,584.00	0.01
银华MSCI中国A 股ETF发起式联 接	19,591,700.00	10.16	21,341,700.00	9.33

**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 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
工商银行	11,481,525.69	10,421.02	9,317,793.97	33,871.86

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期末投资于基金托管人（中国工商银行股份有限公司）发行的股票：工商银行（代码 601398）374,470.00 股，期末公允价值为人民币 1,936,009.90 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.64%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东（第一创业证券股份有限公司）发行的股票：第一创业（代码 002797）25,063.00 股，期末公允价值为人民币 178,949.82 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.06%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东（东北证券股份有限公司）发行的股票：东北证券（代码 000686）13,981.00 股，期末公允价值为人民币 118,139.45 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.04%。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末(2021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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新发流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德国	2021年	2021	新发流	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-

	特	2月24日	年9月3日	通受限							
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新发流通受限	47.33	251.96	190	8,992.70	47,872.40		-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34		-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50		-

			日							
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新发流通受限	28.28	115.71	189	5,344.92	21,869.19	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新发流通受限	33.22	87.50	287	9,534.14	25,112.50	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新发流通受限	24.90	24.81	268	6,673.20	6,649.08	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-



		日	月 2 日							
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新发流通受限	12.54	27.89	649	8,138.46	18,100.61	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-

605162	新中港	2021年6月29日	2021年07月07日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年07月09日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688216	气派科技	2021年6月15日	2021年12月23日	新发流通受限	14.82	47.64	2,000	29,640.00	95,280.00	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年07月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新发流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688350	富森科技	2021年1月21日	2021年7月28日	新发流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新发流通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	新发流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688606	奥泰生物	2021年3月17日	2021年9月27日	新发流通受限	133.67	139.31	1,149	153,586.83	160,067.19	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新发流通受限	28.82	104.16	2,139	61,645.98	222,798.24	-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新发流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688682	霍莱	2021年	2021	新发流	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-

	沃	4月13日	年10月20日	通受限						
--	---	-------	---------	-----	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	7,850	159,669.71	442,347.50	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年07月06日	6.15	56,412	497,538.89	315,343.08	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,481,525.69	-	-	-	11,481,525.69
结算备付金	427,575.06	-	-	-	427,575.06
存出保证金	1,199,162.83	-	-	-	1,199,162.83
交易性金融资产	-	-	-	-290,975,404.25	290,975,404.25
应收利息	-	-	-	1,234.46	1,234.46
应收证券清算款	-	-	-	372,241.78	372,241.78
其他资产	-	-	-	108,234.96	108,234.96
资产总计	13,108,263.58	-	-	-291,457,115.45	304,565,379.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	124,077.13	124,077.13
应付托管费	-	-	-	24,815.43	24,815.43
应付证券清算款	-	-	-	559.00	559.00
应付交易费用	-	-	-	71,726.61	71,726.61
应交税费	-	-	-	1,096.07	1,096.07
其他负债	-	-	-	203,343.22	203,343.22
负债总计	-	-	-	425,617.46	425,617.46
利率敏感度缺口	13,108,263.58	-	-	-291,031,497.99	304,139,761.57
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,360,723.47	-	-	-	6,360,723.47
结算备付金	639,631.24	-	-	-	639,631.24
存出保证金	90,775.27	-	-	-	90,775.27
交易性金融资产	-	-	-	-334,392,157.85	334,392,157.85
应收证券清算款	-	-	-	1,982,340.43	1,982,340.43
应收利息	-	-	-	1,003.37	1,003.37
资产总计	7,091,129.98	-	-	-336,375,501.65	343,466,631.63

负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,328,409.23	5,328,409.23
应付管理人报酬	-	-	-	147,035.00	147,035.00
应付托管费	-	-	-	29,407.00	29,407.00
应付交易费用	-	-	-	216,017.59	216,017.59
其他负债	-	-	-	941,861.58	941,861.58
负债总计	-	-	-	6,662,730.40	6,662,730.40
利率敏感度缺口	7,091,129.98	-	-	-329,712,771.25	336,803,901.23

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	290,975,404.25	95.67	334,392,157.85	99.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	290,975,404.25	95.67	334,392,157.85	99.28

#### 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	15,030,251.64	16,728,065.88
	业绩比较基准下降 5%	-15,030,251.64	-16,728,065.88

#### 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	290,975,404.25	95.54
	其中：股票	290,975,404.25	95.54
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	11,909,100.75	3.91
8	其他各项资产	1,680,874.03	0.55
9	合计	304,565,379.03	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,910,228.72	0.96
B	采矿业	6,972,576.98	2.29
C	制造业	170,249,459.23	55.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,154,102.20	1.69
E	建筑业	3,258,170.81	1.07
F	批发和零售业	3,984,922.90	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	7,889,417.41	2.59
H	住宿和餐饮业	504,349.20	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,633,547.33	2.84
J	金融业	53,783,135.37	17.68
K	房地产业	5,877,278.86	1.93
L	租赁和商务服务业	6,127,007.61	2.01
M	科学研究和技术服务业	3,784,572.78	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	297,157.25	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	283,017.72	0.09
Q	卫生和社会工作	4,640,385.98	1.53
R	文化、体育和娱乐业	1,331,692.97	0.44
S	综合	-	-
	合计	285,681,023.32	93.93

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,993,403.90	0.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	279,559.50	0.09
F	批发和零售业	28,465.12	0.01



G	交通运输、仓储和邮政业	933,379.08	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	418,553.05	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	195,797.28	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	278,696.83	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	142,215.50	0.05
S	综合	-	-
	合计	5,294,380.93	1.74

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,512	15,449,930.40	5.08
2	300750	宁德时代	13,915	7,441,742.00	2.45
3	000858	五粮液	23,120	6,887,216.80	2.26
4	600036	招商银行	122,795	6,654,261.05	2.19
5	601888	中国中免	14,850	4,456,485.00	1.47
6	601318	中国平安	64,438	4,142,074.64	1.36
7	601012	隆基股份	46,332	4,116,134.88	1.35
8	600276	恒瑞医药	51,567	3,505,008.99	1.15
9	300760	迈瑞医疗	7,298	3,503,404.90	1.15
10	000001	平安银行	145,528	3,291,843.36	1.08
11	600900	长江电力	135,398	2,794,614.72	0.92
12	002594	比亚迪	10,786	2,707,286.00	0.89
13	603288	海天味业	20,871	2,691,315.45	0.88
14	600309	万华化学	23,716	2,580,775.12	0.85
15	601166	兴业银行	123,676	2,541,541.80	0.84

16	000333	美的集团	35,500	2,533,635.00	0.83
17	603259	药明康德	15,222	2,383,612.98	0.78
18	600809	山西汾酒	5,181	2,321,088.00	0.76
19	300015	爱尔眼科	31,861	2,261,493.78	0.74
20	000568	泸州老窖	8,675	2,046,779.50	0.67
21	600887	伊利股份	55,135	2,030,622.05	0.67
22	300059	东方财富	61,527	2,017,470.33	0.66
23	601398	工商银行	374,470	1,936,009.90	0.64
24	002475	立讯精密	41,695	1,917,970.00	0.63
25	002714	牧原股份	31,291	1,903,118.62	0.63
26	002304	洋河股份	8,931	1,850,503.20	0.61
27	002352	顺丰控股	27,109	1,835,279.30	0.60
28	300122	智飞生物	9,495	1,773,001.35	0.58
29	601919	中远海控	57,647	1,760,539.38	0.58
30	600000	浦发银行	174,751	1,747,510.00	0.57
31	603501	韦尔股份	5,157	1,660,554.00	0.55
32	600436	片仔癀	3,556	1,594,154.80	0.52
33	002812	恩捷股份	6,791	1,589,773.10	0.52
34	600030	中信证券	63,421	1,581,719.74	0.52
35	300124	汇川技术	20,770	1,542,380.20	0.51
36	600031	三一重工	50,507	1,468,238.49	0.48
37	601818	光大银行	379,244	1,433,542.32	0.47
38	600016	民生银行	321,745	1,418,895.45	0.47
39	002142	宁波银行	35,804	1,395,281.88	0.46
40	000002	万科A	57,921	1,379,099.01	0.45
41	300274	阳光电源	11,802	1,357,938.12	0.45
42	601288	农业银行	443,454	1,343,665.62	0.44
43	601816	京沪高铁	243,547	1,288,363.63	0.42
44	000725	京东方A	201,579	1,257,852.96	0.41
45	600104	上汽集团	55,035	1,209,118.95	0.40
46	600690	海尔智家	46,112	1,194,761.92	0.39
47	601601	中国太保	40,776	1,181,280.72	0.39
48	300014	亿纬锂能	11,245	1,168,692.85	0.38
49	601668	中国建筑	249,776	1,161,458.40	0.38
50	600438	通威股份	26,776	1,158,597.52	0.38
51	002027	分众传媒	122,168	1,149,600.88	0.38
52	601328	交通银行	233,630	1,144,787.00	0.38
53	601899	紫金矿业	117,487	1,138,449.03	0.37
54	300782	卓胜微	2,069	1,112,087.50	0.37
55	600019	宝钢股份	143,281	1,094,666.84	0.36
56	600585	海螺水泥	26,390	1,083,309.50	0.36
57	002493	荣盛石化	60,289	1,041,191.03	0.34

58	601211	国泰君安	56,017	960,131.38	0.32
59	600406	国电南瑞	41,183	957,092.92	0.31
60	000661	长春高新	2,452	948,924.00	0.31
61	600660	福耀玻璃	16,729	934,314.65	0.31
62	600346	恒力石化	34,943	916,904.32	0.30
63	600837	海通证券	79,176	910,524.00	0.30
64	601688	华泰证券	57,395	906,841.00	0.30
65	002230	科大讯飞	13,280	897,462.40	0.30
66	000338	潍柴动力	50,180	896,716.60	0.29
67	000538	云南白药	7,640	884,100.80	0.29
68	300433	蓝思科技	29,635	871,565.35	0.29
69	002241	歌尔股份	20,300	867,622.00	0.29
70	600196	复星医药	11,985	864,478.05	0.28
71	600048	保利地产	71,226	857,561.04	0.28
72	600703	三安光电	26,641	853,844.05	0.28
73	601169	北京银行	175,246	853,448.02	0.28
74	300759	康龙化成	3,900	846,261.00	0.28
75	600893	航发动力	15,808	840,827.52	0.28
76	600999	招商证券	44,172	840,151.44	0.28
77	002371	北方华创	3,008	834,359.04	0.27
78	603799	华友钴业	7,249	827,835.80	0.27
79	600028	中国石化	189,579	826,564.44	0.27
80	601088	中国神华	41,902	817,927.04	0.27
81	601066	中信建投	25,720	808,379.60	0.27
82	002460	赣锋锂业	6,660	806,459.40	0.27
83	002311	海大集团	9,866	805,065.60	0.26
84	600763	通策医疗	1,943	798,573.00	0.26
85	601658	邮储银行	158,336	794,846.72	0.26
86	601100	恒立液压	9,236	793,557.12	0.26
87	300347	泰格医药	4,044	781,705.20	0.26
88	000063	中兴通讯	22,976	763,492.48	0.25
89	603986	兆易创新	3,924	737,319.60	0.24
90	600298	安琪酵母	13,510	734,673.80	0.24
91	300413	芒果超媒	10,588	726,336.80	0.24
92	600745	闻泰科技	7,443	721,226.70	0.24
93	601225	陕西煤业	59,501	705,086.85	0.23
94	002129	中环股份	18,077	697,772.20	0.23
95	000625	长安汽车	26,533	697,287.24	0.23
96	601229	上海银行	84,581	693,564.20	0.23
97	601989	中国重工	166,271	685,036.52	0.23
98	601857	中国石油	128,516	679,849.64	0.22
99	601138	工业富联	53,616	665,374.56	0.22

100	600183	生益科技	28,407	665,007.87	0.22
101	002050	三花智控	27,321	655,157.58	0.22
102	300454	深信服	2,507	650,516.36	0.21
103	603486	科沃斯	2,850	650,028.00	0.21
104	601988	中国银行	209,146	644,169.68	0.21
105	300999	金龙鱼	7,565	642,722.40	0.21
106	601985	中国核电	126,853	641,876.18	0.21
107	600588	用友网络	19,219	639,223.94	0.21
108	000100	TCL 科技	83,516	638,897.40	0.21
109	601390	中国中铁	121,187	635,019.88	0.21
110	000166	申万宏源	134,150	627,822.00	0.21
111	601009	南京银行	59,535	626,308.20	0.21
112	600919	江苏银行	87,892	624,033.20	0.21
113	600089	特变电工	47,589	611,518.65	0.20
114	300601	康泰生物	4,054	604,046.00	0.20
115	002709	天赐材料	5,526	588,961.08	0.19
116	600872	中炬高新	14,007	588,574.14	0.19
117	600760	中航沈飞	9,759	588,467.70	0.19
118	603589	口子窖	8,689	588,158.41	0.19
119	603882	金城医学	3,669	586,196.13	0.19
120	600741	华域汽车	22,212	583,509.24	0.19
121	601901	方正证券	62,256	582,716.16	0.19
122	600570	恒生电子	6,226	580,574.50	0.19
123	600132	重庆啤酒	2,932	580,389.40	0.19
124	601633	长城汽车	13,300	579,747.00	0.19
125	603806	福斯特	5,500	578,215.00	0.19
126	600015	华夏银行	92,750	574,122.50	0.19
127	601336	新华保险	12,436	570,936.76	0.19
128	600150	中国船舶	34,400	567,944.00	0.19
129	300142	沃森生物	9,152	564,678.40	0.19
130	601155	新城控股	13,497	561,475.20	0.18
131	603659	璞泰来	4,108	561,152.80	0.18
132	601628	中国人寿	16,523	559,964.47	0.18
133	300496	中科创达	3,549	557,405.94	0.18
134	000596	古井贡酒	2,324	556,598.00	0.18
135	002049	紫光国微	3,577	551,537.63	0.18
136	002821	凯莱英	1,471	548,094.60	0.18
137	000895	双汇发展	17,194	546,769.20	0.18
138	300498	温氏股份	37,918	544,881.66	0.18
139	603993	洛阳钼业	105,141	542,527.56	0.18
140	000776	广发证券	35,266	533,927.24	0.18
141	300595	欧普康视	5,056	523,548.80	0.17

142	600926	杭州银行	35,332	521,147.00	0.17
143	002179	中航光电	6,571	519,240.42	0.17
144	001979	招商蛇口	47,162	516,423.90	0.17
145	600754	锦江酒店	8,856	504,349.20	0.17
146	000799	酒鬼酒	1,969	503,276.40	0.17
147	600989	宝丰能源	36,300	496,584.00	0.16
148	600176	中国巨石	31,896	494,706.96	0.16
149	002841	视源股份	3,948	490,696.92	0.16
150	600600	青岛啤酒	4,197	485,383.05	0.16
151	600606	绿地控股	88,065	479,954.25	0.16
152	000963	华东医药	10,402	478,596.02	0.16
153	603737	三棵树	2,706	476,256.00	0.16
154	603899	晨光文具	5,519	466,686.64	0.15
155	600958	东方证券	46,703	466,562.97	0.15
156	002601	龙佰集团	13,399	463,337.42	0.15
157	300408	三环集团	10,809	458,517.78	0.15
158	300628	亿联网络	5,418	454,028.40	0.15
159	300450	先导智能	7,545	453,756.30	0.15
160	600111	北方稀土	21,605	447,223.50	0.15
161	600460	士兰微	7,850	442,347.50	0.15
162	601615	明阳智能	27,300	441,987.00	0.15
163	002373	千方科技	26,391	440,729.70	0.14
164	002001	新和成	15,323	439,463.64	0.14
165	600079	人福医药	15,452	436,828.04	0.14
166	000768	中航西飞	16,476	432,989.28	0.14
167	600352	浙江龙盛	31,171	428,289.54	0.14
168	601877	正泰电器	12,827	428,165.26	0.14
169	603833	欧派家居	3,006	426,731.76	0.14
170	600009	上海机场	8,846	425,757.98	0.14
171	002568	百润股份	4,446	421,436.34	0.14
172	600010	包钢股份	271,405	420,677.75	0.14
173	600332	白云山	12,360	418,386.00	0.14
174	601788	光大证券	23,272	416,336.08	0.14
175	600547	山东黄金	21,501	413,249.22	0.14
176	601600	中国铝业	77,847	412,589.10	0.14
177	002736	国信证券	38,108	409,661.00	0.13
178	300529	健帆生物	4,742	409,519.12	0.13
179	300285	国瓷材料	8,377	408,378.75	0.13
180	603369	今世缘	7,501	406,254.16	0.13
181	601669	中国电建	104,061	402,716.07	0.13
182	000301	东方盛虹	19,200	401,280.00	0.13
183	600584	长电科技	10,600	399,408.00	0.13

184	300677	英科医疗	3,200	399,360.00	0.13
185	600886	国投电力	41,508	398,891.88	0.13
186	002648	卫星石化	10,160	398,170.40	0.13
187	002007	华兰生物	10,854	398,124.72	0.13
188	601916	浙商银行	99,478	394,927.66	0.13
189	000786	北新建材	10,037	393,952.25	0.13
190	000876	新希望	26,804	393,214.68	0.13
191	002064	华峰化学	27,600	391,920.00	0.13
192	600426	华鲁恒升	12,613	390,372.35	0.13
193	688185	康希诺	500	388,885.00	0.13
194	000157	中联重科	42,057	388,606.68	0.13
195	300316	晶盛机电	7,690	388,345.00	0.13
196	002600	领益智造	41,966	385,667.54	0.13
197	601377	兴业证券	39,877	385,211.82	0.13
198	002414	高德红外	13,918	383,858.44	0.13
199	600885	宏发股份	6,091	381,905.70	0.13
200	601939	建设银行	57,130	379,914.50	0.12
201	002791	坚朗五金	1,948	378,009.40	0.12
202	600061	国投资本	44,502	377,821.98	0.12
203	601799	星宇股份	1,673	377,629.56	0.12
204	600779	水井坊	2,983	376,902.05	0.12
205	002236	大华股份	17,851	376,656.10	0.12
206	000938	紫光股份	17,030	372,616.40	0.12
207	603345	安井食品	1,451	368,583.02	0.12
208	601607	上海医药	17,399	367,640.87	0.12
209	600029	南方航空	60,779	365,889.58	0.12
210	000069	华侨城A	48,797	363,049.68	0.12
211	002557	洽洽食品	8,392	361,695.20	0.12
212	601966	玲珑轮胎	8,222	359,630.28	0.12
213	603160	汇顶科技	2,773	359,463.99	0.12
214	300661	圣邦股份	1,422	359,382.06	0.12
215	603185	上机数控	2,000	357,900.00	0.12
216	600362	江西铜业	15,931	356,535.78	0.12
217	300033	同花顺	3,157	356,046.46	0.12
218	603816	顾家家居	4,594	355,024.32	0.12
219	600219	南山铝业	98,531	354,711.60	0.12
220	601360	三六零	28,364	346,324.44	0.11
221	603866	桃李面包	11,073	345,477.60	0.11
222	300003	乐普医疗	10,595	340,311.40	0.11
223	600845	宝信软件	6,659	338,943.10	0.11
224	600115	中国东航	66,706	338,866.48	0.11
225	300088	长信科技	40,571	335,116.46	0.11

226	002074	国轩高科	7,659	333,626.04	0.11
227	002508	老板电器	7,166	333,219.00	0.11
228	300146	汤臣倍健	10,103	332,388.70	0.11
229	002353	杰瑞股份	7,435	332,344.50	0.11
230	601216	君正集团	64,984	330,768.56	0.11
231	002916	深南电路	2,965	329,500.45	0.11
232	600489	中金黄金	38,188	329,180.56	0.11
233	601233	桐昆股份	13,613	327,937.17	0.11
234	002938	鹏鼎控股	9,100	326,508.00	0.11
235	601995	中金公司	5,214	320,661.00	0.11
236	600143	金发科技	15,294	319,032.84	0.10
237	601618	中国中冶	106,273	316,693.54	0.10
238	002024	苏宁易购	56,412	315,343.08	0.10
239	601881	中国银河	28,880	311,326.40	0.10
240	002459	晶澳科技	6,344	310,856.00	0.10
241	601021	春秋航空	5,453	310,275.70	0.10
242	300212	易华录	11,480	308,926.80	0.10
243	002920	德赛西威	2,800	308,224.00	0.10
244	601111	中国国航	39,542	307,636.76	0.10
245	300296	利亚德	39,302	307,341.64	0.10
246	300207	欣旺达	9,343	304,208.08	0.10
247	002555	三七互娱	12,599	302,627.98	0.10
248	603517	绝味食品	3,588	302,432.52	0.10
249	601878	浙商证券	23,062	301,650.96	0.10
250	002252	上海莱士	40,168	300,858.32	0.10
251	300676	华大基因	2,508	297,448.80	0.10
252	000425	徐工机械	46,666	297,262.42	0.10
253	601636	旗滨集团	16,000	296,960.00	0.10
254	603605	珀莱雅	1,478	290,737.38	0.10
255	603939	益丰药房	5,166	289,760.94	0.10
256	601077	渝农商行	72,338	288,628.62	0.09
257	600521	华海药业	13,692	285,888.96	0.09
258	002602	世纪华通	44,357	284,771.94	0.09
259	002607	中公教育	13,548	283,017.72	0.09
260	300223	北京君正	2,802	282,777.84	0.09
261	600161	天坛生物	8,237	282,117.25	0.09
262	600875	东方电气	25,224	276,707.28	0.09
263	002624	完美世界	11,555	276,280.05	0.09
264	600383	金地集团	26,855	274,995.20	0.09
265	688008	澜起科技	4,400	274,472.00	0.09
266	300751	迈为股份	600	272,820.00	0.09
267	601838	成都银行	21,487	271,595.68	0.09

268	300558	贝达药业	2,503	270,924.72	0.09
269	600529	山东药玻	7,974	270,717.30	0.09
270	600674	川投能源	21,828	269,139.24	0.09
271	601727	上海电气	63,438	268,977.12	0.09
272	601865	福莱特	6,800	268,804.00	0.09
273	601933	永辉超市	56,661	268,006.53	0.09
274	002138	顺络电子	6,900	267,513.00	0.09
275	002625	光启技术	12,855	267,512.55	0.09
276	603338	浙江鼎力	4,546	266,804.74	0.09
277	002340	格林美	28,484	266,325.40	0.09
278	002690	美亚光电	4,767	265,807.92	0.09
279	600699	均胜电子	10,353	264,208.56	0.09
280	600018	上港集团	55,166	263,141.82	0.09
281	603658	安图生物	3,462	262,315.74	0.09
282	000703	恒逸石化	21,908	261,800.60	0.09
283	300144	宋城演艺	15,543	261,122.40	0.09
284	002080	中材科技	9,968	260,862.56	0.09
285	601058	赛轮轮胎	26,000	259,740.00	0.09
286	688002	睿创微纳	2,600	259,558.00	0.09
287	601117	中国化学	29,390	257,456.40	0.08
288	603127	昭衍新药	1,400	257,250.00	0.08
289	600862	中航高科	8,341	256,735.98	0.08
290	600642	申能股份	41,739	256,277.46	0.08
291	601231	环旭电子	15,176	255,108.56	0.08
292	601555	东吴证券	30,575	254,995.50	0.08
293	000066	中国长城	17,443	254,667.80	0.08
294	000825	太钢不锈	33,915	254,023.35	0.08
295	600705	中航产融	65,604	253,887.48	0.08
296	603218	日月股份	9,300	251,844.00	0.08
297	600522	中天科技	25,124	251,240.00	0.08
298	002185	华天科技	16,302	250,887.78	0.08
299	601162	天风证券	51,616	250,853.76	0.08
300	002202	金风科技	20,513	249,438.08	0.08
301	300037	新宙邦	2,489	249,148.90	0.08
302	600998	九州通	16,138	248,041.06	0.08
303	600380	健康元	18,038	247,661.74	0.08
304	601689	拓普集团	6,578	246,214.54	0.08
305	300724	捷佳伟创	2,105	244,201.05	0.08
306	600256	广汇能源	72,771	242,327.43	0.08
307	000977	浪潮信息	8,608	242,143.04	0.08
308	600739	辽宁成大	11,627	241,957.87	0.08
309	600315	上海家化	4,008	241,041.12	0.08



310	000783	长江证券	32,905	240,864.60	0.08
311	000932	华菱钢铁	36,437	240,484.20	0.08
312	603233	大参林	4,689	239,654.79	0.08
313	603456	九洲药业	4,900	238,042.00	0.08
314	600704	物产中大	30,173	237,461.51	0.08
315	600188	兖州煤业	15,417	236,805.12	0.08
316	600549	厦门钨业	11,329	235,983.07	0.08
317	600867	通化东宝	19,678	234,955.32	0.08
318	002120	韵达股份	17,266	233,608.98	0.08
319	002013	中航机电	23,139	233,009.73	0.08
320	002444	巨星科技	6,800	231,744.00	0.08
321	300699	光威复材	3,041	230,963.95	0.08
322	601990	南京证券	21,936	230,766.72	0.08
323	603444	吉比特	435	230,550.00	0.08
324	688009	中国通号	40,300	229,307.00	0.08
325	600372	中航电子	13,854	229,283.70	0.08
326	600109	国金证券	18,025	228,737.25	0.08
327	603858	步长制药	10,139	228,026.11	0.07
328	002223	鱼跃医疗	5,974	227,788.62	0.07
329	600415	小商品城	44,100	227,115.00	0.07
330	002409	雅克科技	2,800	226,800.00	0.07
331	601696	中银证券	11,000	226,490.00	0.07
332	300308	中际旭创	5,879	226,459.08	0.07
333	601108	财通证券	21,347	223,930.03	0.07
334	600655	豫园股份	19,309	223,791.31	0.07
335	601699	潞安环能	18,917	223,409.77	0.07
336	601872	招商轮船	48,168	222,536.16	0.07
337	000807	云铝股份	18,700	222,530.00	0.07
338	002157	正邦科技	18,479	220,824.05	0.07
339	603883	老百姓	4,189	220,676.52	0.07
340	002463	沪电股份	14,196	219,612.12	0.07
341	002673	西部证券	26,582	219,301.50	0.07
342	601198	东兴证券	19,872	217,200.96	0.07
343	000027	深圳能源	23,622	216,613.74	0.07
344	600511	国药股份	6,541	216,245.46	0.07
345	002511	中顺洁柔	7,845	216,129.75	0.07
346	603638	艾迪精密	4,979	213,449.73	0.07
347	002044	美年健康	23,317	212,417.87	0.07
348	002384	东山精密	10,160	211,734.40	0.07
349	000830	鲁西化工	11,300	211,649.00	0.07
350	603613	国联股份	2,100	209,937.00	0.07
351	600486	扬农化工	1,878	209,904.06	0.07

352	002603	以岭药业	7,194	209,777.04	0.07
353	601319	中国人保	35,248	209,020.64	0.07
354	002078	太阳纸业	15,603	208,300.05	0.07
355	300253	卫宁健康	12,729	207,100.83	0.07
356	000739	普洛药业	7,041	207,005.40	0.07
357	000050	深天马 A	14,592	206,914.56	0.07
358	000728	国元证券	25,941	206,749.77	0.07
359	002180	纳思达	6,410	206,402.00	0.07
360	600027	华电国际	59,892	206,028.48	0.07
361	002294	信立泰	6,238	205,230.20	0.07
362	002032	苏泊尔	3,217	205,212.43	0.07
363	000983	山西焦煤	24,422	202,946.82	0.07
364	002405	四维图新	13,622	200,243.40	0.07
365	000800	一汽解放	18,486	200,018.52	0.07
366	002507	涪陵榨菜	5,287	199,108.42	0.07
367	600153	建发股份	24,383	197,502.30	0.06
368	002430	杭氧股份	5,700	197,163.00	0.06
369	300357	我武生物	3,073	197,040.76	0.06
370	688006	杭可科技	2,300	195,500.00	0.06
371	002372	伟星新材	9,447	195,269.49	0.06
372	000423	东阿阿胶	5,412	194,344.92	0.06
373	603707	健友股份	4,617	192,759.75	0.06
374	000723	美锦能源	25,398	192,008.88	0.06
375	600160	巨化股份	21,691	191,748.44	0.06
376	600827	百联股份	9,500	191,425.00	0.06
377	002156	通富微电	7,953	191,190.12	0.06
378	300251	光线传媒	17,475	188,904.75	0.06
379	600233	圆通速递	18,846	188,648.46	0.06
380	002429	兆驰股份	30,918	187,672.26	0.06
381	600803	新奥股份	11,300	186,563.00	0.06
382	002152	广电运通	14,297	186,289.91	0.06
383	600583	海油工程	41,254	185,643.00	0.06
384	000860	顺鑫农业	4,395	185,381.10	0.06
385	600011	华能国际	43,625	184,097.50	0.06
386	000656	金科股份	31,755	183,861.45	0.06
387	600038	中直股份	3,472	183,113.28	0.06
388	000513	丽珠集团	3,652	182,673.04	0.06
389	601598	中国外运	36,054	182,072.70	0.06
390	600177	雅戈尔	27,548	181,541.32	0.06
391	002541	鸿路钢构	3,100	180,885.00	0.06
392	600392	盛和资源	10,400	180,544.00	0.06
393	600170	上海建工	65,349	180,363.24	0.06

394	000547	航天发展	9,528	179,793.36	0.06
395	603267	鸿远电子	1,400	179,088.00	0.06
396	002797	第一创业	25,063	178,949.82	0.06
397	002030	达安基因	8,404	178,500.96	0.06
398	600039	四川路桥	28,400	178,068.00	0.06
399	300136	信维通信	5,763	177,961.44	0.06
400	002299	圣农发展	7,441	177,691.08	0.06
401	000021	深科技	9,256	177,159.84	0.06
402	002242	九阳股份	5,427	176,323.23	0.06
403	300482	万孚生物	2,698	174,533.62	0.06
404	600340	华夏幸福	33,200	173,968.00	0.06
405	600879	航天电子	22,989	172,877.28	0.06
406	002939	长城证券	15,405	171,457.65	0.06
407	600536	中国软件	2,997	170,619.21	0.06
408	000630	铜陵有色	62,683	170,497.76	0.06
409	002385	大北农	25,020	170,136.00	0.06
410	002422	科伦药业	8,517	169,914.15	0.06
411	600848	上海临港	9,470	169,513.00	0.06
412	600516	方大炭素	22,661	168,597.84	0.06
413	000709	河钢股份	68,373	168,197.58	0.06
414	600895	张江高科	9,184	167,791.68	0.06
415	600026	中远海能	27,078	166,800.48	0.05
416	603712	七一二	4,578	165,265.80	0.05
417	600066	宇通客车	13,215	165,055.35	0.05
418	600498	烽火通信	8,609	160,385.67	0.05
419	002563	森马服饰	13,421	160,380.95	0.05
420	002266	浙富控股	31,900	159,181.00	0.05
421	600598	北大荒	10,571	158,142.16	0.05
422	000975	银泰黄金	16,525	157,152.75	0.05
423	600909	华安证券	28,023	156,088.11	0.05
424	000999	华润三九	5,831	155,979.25	0.05
425	600801	华新水泥	8,858	155,635.06	0.05
426	601098	中南传媒	17,611	155,329.02	0.05
427	002010	传化智联	19,638	151,408.98	0.05
428	002926	华西证券	15,605	150,276.15	0.05
429	601128	常熟银行	24,224	150,188.80	0.05
430	002925	盈趣科技	3,846	149,647.86	0.05
431	600988	赤峰黄金	9,882	148,131.18	0.05
432	601456	国联证券	9,573	147,424.20	0.05
433	601992	金隅集团	54,776	147,347.44	0.05
434	002065	东华软件	18,577	147,315.61	0.05
435	002146	荣盛发展	25,847	145,777.08	0.05

436	002705	新宝股份	5,500	144,375.00	0.05
437	002075	沙钢股份	13,171	143,695.61	0.05
438	002500	山西证券	21,351	143,265.21	0.05
439	000738	航发控制	6,842	142,518.86	0.05
440	002127	南极电商	14,575	142,397.75	0.05
441	002456	欧菲光	16,028	142,328.64	0.05
442	002958	青农商行	33,062	141,505.36	0.05
443	000988	华工科技	5,993	140,955.36	0.05
444	002153	石基信息	5,958	140,072.58	0.05
445	002212	天融信	7,031	139,002.87	0.05
446	000987	越秀金控	10,920	138,247.20	0.05
447	300070	碧水源	18,875	137,976.25	0.05
448	300463	迈克生物	3,274	137,802.66	0.05
449	601099	太平洋	40,602	137,640.78	0.05
450	000750	国海证券	32,390	137,333.60	0.05
451	600688	上海石化	36,306	136,510.56	0.04
452	300773	拉卡拉	4,748	134,036.04	0.04
453	002558	巨人网络	10,022	133,292.60	0.04
454	000961	中南建设	22,502	133,211.84	0.04
455	600859	王府井	4,603	132,934.64	0.04
456	002151	北斗星通	3,076	132,483.32	0.04
457	300383	光环新网	9,150	131,668.50	0.04
458	002465	海格通信	13,763	130,197.98	0.04
459	000671	阳光城	24,566	127,743.20	0.04
460	002019	亿帆医药	7,381	127,322.25	0.04
461	002081	金螳螂	15,959	126,395.28	0.04
462	000998	隆平高科	7,880	126,395.20	0.04
463	603027	千禾味业	4,740	124,614.60	0.04
464	002683	宏大爆破	4,441	123,326.57	0.04
465	000729	燕京啤酒	16,778	121,472.72	0.04
466	002506	协鑫集成	34,880	121,382.40	0.04
467	000402	金融街	17,811	120,224.25	0.04
468	000686	东北证券	13,981	118,139.45	0.04
469	000629	攀钢钒钛	51,147	117,126.63	0.04
470	002727	一心堂	3,500	115,885.00	0.04
471	300418	昆仑万维	7,002	114,692.76	0.04
472	000540	中天金融	41,746	113,966.58	0.04
473	002572	索菲亚	4,640	112,288.00	0.04
474	001914	招商积余	6,325	108,663.50	0.04
475	000623	吉林敖东	6,947	107,609.03	0.04
476	000627	天茂集团	29,436	106,558.32	0.04
477	000581	威孚高科	4,969	103,504.27	0.03

478	000401	冀东水泥	8,065	99,602.75	0.03
479	002399	海普瑞	6,198	98,734.14	0.03
480	002131	利欧股份	40,229	94,135.86	0.03

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	117,486	773,057.88	0.25
2	002271	东方雨虹	13,211	730,832.52	0.24
3	600637	东方明珠	34,448	282,129.12	0.09
4	600201	生物股份	16,135	281,555.75	0.09
5	600068	葛洲坝	33,937	254,188.13	0.08
6	688626	翔宇医疗	2,139	222,798.24	0.07
7	600487	亨通光电	18,400	209,760.00	0.07
8	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.07
9	600208	新湖中宝	64,407	195,797.28	0.06
10	600004	白云机场	14,340	160,321.20	0.05
11	688606	奥泰生物	1,149	160,067.19	0.05
12	688136	科兴制药	4,032	149,506.56	0.05
13	600977	中国电影	11,350	142,215.50	0.05
14	688313	仕佳光子	7,151	129,647.63	0.04
15	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.04
16	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.03
17	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.03
18	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.03
19	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.03
20	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
21	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.02
22	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
23	688156	路德环境	2,602	47,928.84	0.02
24	300957	贝泰妮	190	47,872.40	0.02
25	300919	中伟股份	284	46,292.00	0.02
26	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
27	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
28	300979	华利集团	287	25,112.50	0.01
29	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
30	300973	立高食品	189	21,869.19	0.01
31	301009	可靠股份	649	18,100.61	0.01
32	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
33	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
34	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
35	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00

36	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
37	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
38	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
39	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
40	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
41	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
42	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
43	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
44	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
45	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
46	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
47	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
48	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
49	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
50	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
51	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
52	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
53	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
54	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
55	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
56	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
57	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
58	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
59	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
60	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
61	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
62	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
63	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
64	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
65	300985	致远新能	268	6,649.08	0.00
66	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
67	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
68	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
69	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
70	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
71	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
72	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
73	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
74	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
75	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
76	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
77	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
78	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

79	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
----	--------	------	-----	----------	------

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	4,227,614.00	1.26
2	300750	宁德时代	3,977,145.00	1.18
3	000333	美的集团	3,849,758.80	1.14
4	000001	平安银行	2,198,818.00	0.65
5	002352	顺丰控股	1,993,438.00	0.59
6	300760	迈瑞医疗	1,872,334.00	0.56
7	000568	泸州老窖	1,844,858.98	0.55
8	600276	恒瑞医药	1,733,054.00	0.51
9	002714	牧原股份	1,532,522.00	0.46
10	002594	比亚迪	1,482,242.00	0.44
11	002304	洋河股份	1,458,960.00	0.43
12	601818	光大银行	1,410,755.00	0.42
13	002475	立讯精密	1,353,894.00	0.40
14	601012	隆基股份	1,348,811.00	0.40
15	300122	智飞生物	1,308,513.00	0.39
16	300015	爱尔眼科	1,217,581.15	0.36
17	601888	中国中免	1,215,560.00	0.36
18	000002	万科A	1,188,286.19	0.35
19	600887	伊利股份	1,151,399.98	0.34
20	601816	京沪高铁	1,083,644.00	0.32

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	6,175,997.68	1.83
2	300750	宁德时代	5,273,693.58	1.57
3	600519	贵州茅台	4,875,840.81	1.45
4	002415	海康威视	3,970,778.32	1.18
5	000001	平安银行	3,183,738.46	0.95
6	000568	泸州老窖	2,411,714.39	0.72
7	002594	比亚迪	2,125,026.45	0.63
8	300760	迈瑞医疗	2,060,672.00	0.61
9	002352	顺丰控股	2,032,711.34	0.60
10	002714	牧原股份	2,010,219.12	0.60
11	600276	恒瑞医药	1,978,291.72	0.59

12	002304	洋河股份	1,954,558.44	0.58
13	002475	立讯精密	1,938,397.09	0.58
14	600031	三一重工	1,865,681.32	0.55
15	300015	爱尔眼科	1,780,187.95	0.53
16	603259	药明康德	1,698,106.15	0.50
17	300122	智飞生物	1,692,076.54	0.50
18	601012	隆基股份	1,617,252.76	0.48
19	000002	万科A	1,611,173.02	0.48
20	300059	东方财富	1,590,194.97	0.47

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	147,453,583.57
卖出股票收入（成交）总额	171,105,616.94

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2107	IC2107	1	1,353,440.00	37,280.00	-
IF2107	IF2107	4	6,229,440.00	135,360.00	-
公允价值变动总额合计（元）					172,640.00
股指期货投资本期收益（元）					206,621.36
股指期货投资本期公允价值变动（元）					172,640.00



### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,199,162.83
2	应收证券清算款	372,241.78
3	应收股利	-
4	应收利息	1,234.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	108,234.96
8	其他	-
9	合计	1,680,874.03

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
1,941	99,333.12	131,405,126.00	68.15	61,400,456.00	31.85

#### 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式联接基金	19,591,700.00	10.16

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	国开金融有限责任公司	46,440,000.00	24.09
2	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	38,100,000.00	19.76
3	方正证券股份有限公司	4,946,200.00	2.57
4	招商证券股份有限公司	4,761,102.00	2.47
5	中信证券股份有限公司	4,333,222.00	2.25
6	广发证券股份有限公司	4,080,239.00	2.12
7	长盛基金—东兴证券股份有限公司—长盛—长兴优选 1 号单一资产管理计划	3,528,800.00	1.83
8	张晓川	2,880,000.00	1.49
9	赵汝佳	2,360,000.00	1.22
10	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	2,207,200.00	1.14

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式联接基金	19,591,700.00	10.16
----	--	---------------	-------

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 3 月 19 日） 基金份额总额	2,058,805,582.00
本报告期期初基金份额总额	228,805,582.00
本报告期基金总申购份额	93,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	129,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	192,805,582.00

## § 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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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

本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起在投资范围中增加存托凭证，并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期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，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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	134,907,895.89	43.14%	98,659.67	37.33%	-
中泰证券股份有限公司	4	111,676,598.47	35.71%	104,004.11	39.35%	-
兴业证券股份有限公司	1	66,162,843.26	21.16%	61,617.70	23.32%	-
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

东方财富证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
野村东方国 际证券有限 公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	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 融有限公司	4	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有	2	-	-	-	-	-

限公司						
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信 证券股份	-	-	-	-	-	-



有限公司						
西南证券 股份有限 公司						
信达证券 股份有限 公司						
野村东方 国际证券 有限公司						
英大证券 有限责任 公司						
长城证券 股份有限 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						
中国中金 财富证券 有限公司						
中航证券 有限公司						
中信证券 股份有限 公司						

注：本基金本报告期未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旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-01-20
2	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
3	《银华基金管理股份有限公司关于修	本基金管理人网站, 四	2021-01-29

	订旗下部分公募基金基金合同的公告》	大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	
4	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
5	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2021 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
6	《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 (2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
7	《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 (2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
8	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021-03-29
9	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下全部公募指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
11	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2021 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
12	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
13	《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 (2021 年 3 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
14	《银华基金管理股份有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-04-07
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-04-21
16	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
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	本基金管理人网站, 证券时报, 中国证监会基	2021-05-10

	券投资基金变更基金简称、扩位简称及申赎简称的公告》	金电子披露网站	
18	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-05-10

## § 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	2021/01/04-2021/01/26	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/02/02-2021/02/03	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/02/10-2021/02/21	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/04/21-2021/05/11	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/03/10-2021/03/14	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/02/23-2021/03/08	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/04/06-2021/04/11	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	1	2021/02/05-2021/02/07	45235600.00	5764400.00	12900000.00	38100000.00	19.76
	2	2021/01/01-2021/06/30	46440000.00	0.00	0.00	46440000.00	24.09

#### 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 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》, 本基金自 2021 年 1 月 29 日起增加侧袋机制, 在投资范围中增加存托凭证, 并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

2、本基金管理人于 2021 年 3 月 30 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下全部公募指数基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同部分条款的公告》, 对本基金基金合同进行了修订, 补充了关于指数不符合要求、指数编制机构退出等情形时的应急处置安排, 明确了基金运作过程中标的指数成份证券面临退市或违约风险时的处置措施等。本次修订自 2021 年 3 月 30 日起正式生效。

3、本基金管理人于 2021 年 5 月 10 日披露了《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变更基金简称、扩位简称及申赎简称的公告》, 自 2021 年 5 月 11 日起将银华 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”) (二级市场交易代码: 512380, 一级市场申赎代码: 512381) 的基金简称由“银华 MSCI”变更为“MSCI 中国”, 扩位简称由“MSCI 中国指数 ETF”变更为“MSCI 中国 ETF”, 申赎简称由“银华 MSCI”变更为“MSCI 中国”。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

## 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

2021年8月28日