

银华中证沪港深 500 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：招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。

基金托管人招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 2 月 4 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
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	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
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	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
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	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪港深
场内简称	沪港深
基金主代码	517000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,062,793,000.00 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	2021 年 3 月 5 日

注：本基金的扩位证券简称为：沪港深 500ETF

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	本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。 建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。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资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证沪港深 500 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、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。本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张燕
	联系电话	(010) 58163000	0755-83199084
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95555
传真		(010) 58163027	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100738	518040
法定代表人		王珠林	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
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 2 月 4 日(基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-22,436,198.38
本期利润	-72,063,756.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0553
本期加权平均净值利润率	-5.85%
本期基金份额净值增长率	-4.34%
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	-46,117,710.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0434
期末基金资产净值	1,016,675,289.71
期末基金份额净值	0.9566
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	-4.34%

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。

4、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 4 日，2021 年中期报告主要财务指标计算期间为 2021 年 2 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日。

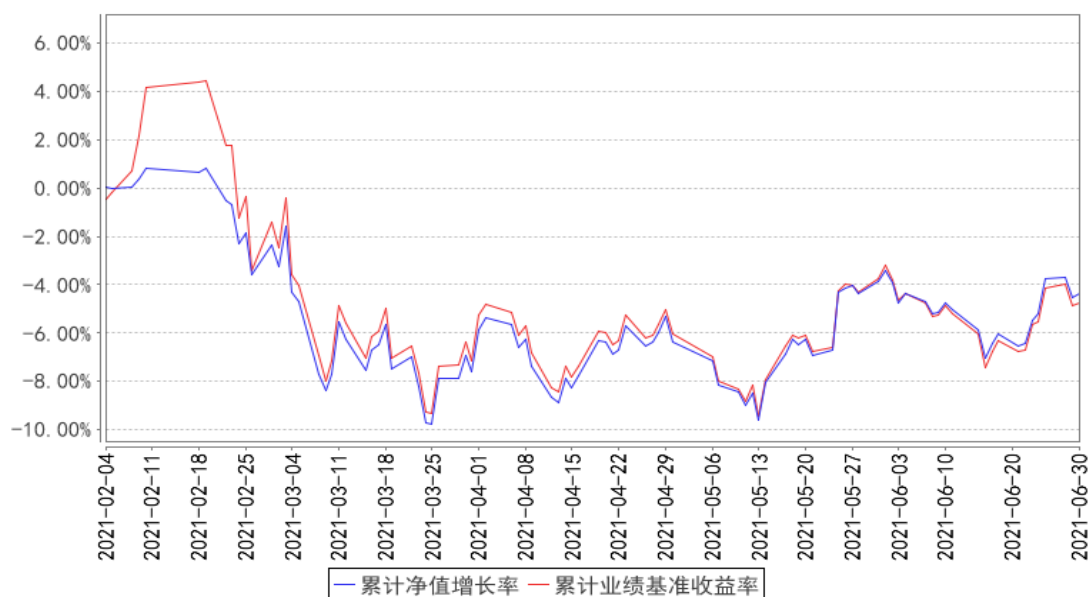
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.48%	0.69%	-1.02%	0.73%	0.54%	-0.04%
过去三个月	3.52%	0.85%	2.62%	0.89%	0.90%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-4.34%	1.03%	-4.75%	1.21%	0.41%	-0.18%

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

沪港深累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2021 年 02 月 04 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按

基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 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、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日

期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 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		

李 宜 璇 女 士	本基金的 基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	7 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 日至 2020 年 12 月 31 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 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 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 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任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基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任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）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任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基金经理，自 2021 年 6 月 24 日起兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
王 帅 先生	本基金的 基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	8.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5

					月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 12 月 10 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 3 日起兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证沪港深 500 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 0.9566 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.34%，业绩比较基准收益率为-4.75%。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：银华中证沪港深 500 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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	55,000,956.21
结算备付金		133,086.44
存出保证金		217,378.19
交易性金融资产	6.4.7.2	969,004,726.60
其中：股票投资		969,004,726.60
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		7,047,665.67
应收利息	6.4.7.5	7,743.66
应收股利		2,516,413.63
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		1,033,927,970.40

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		16,389,263.56
应付赎回款		-
应付管理人报酬		441,210.05
应付托管费		88,242.02
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	289,554.89
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	44,410.17
负债合计		17,252,680.69
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,062,793,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-46,117,710.29
所有者权益合计		1,016,675,289.71
负债和所有者权益总计		1,033,927,970.40

注：1、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 4 日，无上年度可比期间数据。

2、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9566 元，基金份额总额 1,062,793,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生 效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-66,360,722.47
1. 利息收入		392,144.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	392,144.36
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		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,031,488.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-27,766,426.27
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	-
股利收益	6.4.7.16	9,734,937.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-49,627,557.73
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	906,179.53
减：二、费用		5,703,033.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,481,661.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	496,332.34
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,677,039.66
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	48,000.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-72,063,756.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-72,063,756.11

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 4 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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）	1,482,793,000.00	-	1,482,793,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-72,063,756.11	-72,063,756.11

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）	-420,000,000.00	25,946,045.82	-394,053,954.18
其中：1. 基金申购款	5,000,000.00	-235,370.42	4,764,629.58
2. 基金赎回款	-425,000,000.00	26,181,416.24	-398,818,583.76
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）	1,062,793,000.00	-46,117,710.29	1,016,675,289.71

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 4 日，无上年度可比期间数据。

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

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3526 号《关于准予银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,482,793,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0165 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,482,793,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管通知书[2021]76 号核准, 本基金 1,482,793,000.00 份基金份额于 2021 年 3 月 5 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。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资产的 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允许上市的股票、港股通标的股票)、存托凭证、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、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(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为: 中证沪港深 500 指数收益率。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金半年报会计期间为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	55,000,956.21

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	55,000,956.21

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	1,018,632,284.33	969,004,726.60	-49,627,557.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,018,632,284.33	969,004,726.60	-49,627,557.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,692.95
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	2,952.91
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	97.80
合计	7,743.66

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	289,554.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	289,554.89

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	44,410.17
合计	44,410.17

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,482,793,000.00	1,482,793,000.00
本期申购	5,000,000.00	5,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-425,000,000.00	-425,000,000.00
- 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	1,062,793,000.00	1,062,793,000.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-22,436,198.38	-49,627,557.73	-72,063,756.11
本期基金份额交易产生的变动数	3,944,717.72	22,001,328.10	25,946,045.82
其中：基金申购款	-8,085.81	-227,284.61	-235,370.42
基金赎回款	3,952,803.53	22,228,612.71	26,181,416.24

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,491,480.66	-27,626,229.63	-46,117,710.29

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	323,614.45
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	67,088.69
其他	1,441.22
合计	392,144.36

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2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,524,233.05
股票投资收益——赎回差价收入	-8,242,193.22
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	-27,766,426.27

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2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	359,674,739.99
减：卖出股票成本总额	379,198,973.04
买卖股票差价收入	-19,524,233.05

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2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	398,818,583.76
减：现金支付赎回款总额	272,235,590.76

减：赎回股票成本总额	134,825,186.22
赎回差价收入	-8,242,193.22

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

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,734,937.64
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	9,734,937.64

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-49,627,557.73
股票投资	-49,627,557.73
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	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-49,627,557.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	484,831.34
其他	421,348.19
合计	906,179.53

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,677,039.66
银行间市场交易费用	-
合计	2,677,039.66

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,410.17
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	3,589.96
合计	48,000.13

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,481,661.51
其中：支付销售机构的客户维护费	21,192.38

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 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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	496,332.34

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 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

注：无。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	55,000,956.21	323,614.45

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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	-
300960	通业	2021 年	2021 年	新发流	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

	科技	3月22日	9月29日	通受限						
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	-
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	360	10,180.80	41,655.60	-
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	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新发流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
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	295	7,345.50	7,318.95	-
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 2 日	新发流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
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	-
301006	迈拓股份	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新发流 通受限	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
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	801	10,044.54	22,339.89	-
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	-

		日	日							
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 7 月 6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 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 7 月 6 日	新股流 通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

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
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事 项停牌	5.59	-	-	93,200	672,184.62	520,988.00	-

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发行的证券，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	55,000,956.21	-	-	-	55,000,956.21
结算备付金	133,086.44	-	-	-	133,086.44
存出保证金	217,378.19	-	-	-	217,378.19
交易性金融资产	-	-	-	969,004,726.60	969,004,726.60
应收利息	-	-	-	7,743.66	7,743.66
应收股利	-	-	-	2,516,413.63	2,516,413.63
应收证券清算款	-	-	-	7,047,665.67	7,047,665.67
资产总计	55,351,420.84	-	-	978,576,549.56	1,033,927,970.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	441,210.05	441,210.05
应付托管费	-	-	-	88,242.02	88,242.02
应付证券清算款	-	-	-	16,389,263.56	16,389,263.56
应付交易费用	-	-	-	289,554.89	289,554.89
其他负债	-	-	-	44,410.17	44,410.17
负债总计	-	-	-	17,252,680.69	17,252,680.69
利率敏感度缺口	55,351,420.84	-	-	-961,323,868.87	1,016,675,289.71

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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 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，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 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	415,489,707.27	-	415,489,707.27
资产合计	-	415,489,707.27	-	415,489,707.27
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	-	415,489,707.27	-	415,489,707.27

6.4.13.4.2.2 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	
	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）
分析	港币 5%	20,774,485.36
	港币-5%	-20,774,485.36

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险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。

6.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	969,004,726.60	95.31
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	969,004,726.60	95.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相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。	
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（2021 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	40,931,960.42
	业绩比较基准下降	-40,931,960.42

	5%	
--	----	--

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	969,004,726.60	93.72
	其中：股票	969,004,726.60	93.72
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	55,134,042.65	5.33
8	其他各项资产	9,789,201.15	0.95
9	合计	1,033,927,970.40	100.00

注：1、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	5,660,946.00	0.56
B	采矿业	10,871,215.28	1.07
C	制造业	320,541,326.25	31.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,411,471.00	0.83
E	建筑业	6,546,961.00	0.64
F	批发和零售业	3,242,439.70	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	13,910,869.00	1.37
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,103,631.56	2.08
J	金融业	119,556,509.68	11.76
K	房地产业	11,177,356.00	1.10
L	租赁和商务服务业	9,582,064.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	8,564,112.40	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	900,359.00	0.09
Q	卫生和社会工作	10,699,807.02	1.05
R	文化、体育和娱乐业	2,052,960.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	552,822,027.89	54.38

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	566,484.69	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	6,410.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,407.83	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	692,991.44	0.07

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	3,393,771.41	0.33
消费者非必需品	75,763,218.83	7.45
消费者常用品	19,302,512.80	1.90
能源	7,665,145.93	0.75
金融	113,058,367.43	11.12
医疗保健	25,947,457.90	2.55
工业	11,030,547.57	1.08
信息技术	25,617,513.23	2.52
电信服务	85,999,328.86	8.46
公用事业	14,416,740.39	1.42
地产建筑业	33,295,102.92	3.27
合计	415,489,707.27	40.87

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	00700	腾讯控股	157,500	76,534,718.40	7.53
2	03690	美团点评	143,200	38,176,895.46	3.76
3	600519	贵州茅台	14,500	29,822,150.00	2.93
4	01299	友邦保险	283,400	22,755,807.05	2.24
5	00005	汇丰控股	486,000	18,136,930.97	1.78
6	300750	宁德时代	32,417	17,336,611.60	1.71
7	601318	中国平安	252,800	16,249,984.00	1.60
8	600036	招商银行	289,400	15,682,586.00	1.54
9	00939	建设银行	2,818,000	14,326,736.80	1.41
10	000858	五粮液	45,532	13,563,527.48	1.33
11	00388	香港交易所	30,100	11,591,107.38	1.14
12	02318	中国平安	175,500	11,105,584.54	1.09
13	01810	小米集团	469,800	10,554,601.97	1.04
14	02269	药明生物	80,500	9,531,601.21	0.94
15	601012	隆基股份	101,200	8,990,608.00	0.88
16	000333	美的集团	115,000	8,207,550.00	0.81
17	01398	IND&COMMBKOFCHINA-H	2,035,000	7,721,369.57	0.76
18	600276	恒瑞医药	104,640	7,112,380.80	0.70

19	002415	海康威视	109,400	7,056,300.00	0.69
20	601166	兴业银行	339,400	6,974,670.00	0.69
21	601888	中国中免	22,900	6,872,290.00	0.68
22	300760	迈瑞医疗	14,000	6,720,700.00	0.66
23	603259	药明康德	41,960	6,570,516.40	0.65
24	300059	东方财富	192,980	6,327,814.20	0.62
25	03968	招商银行	108,000	5,953,532.40	0.59
26	00941	中国移动	146,000	5,898,032.66	0.58
27	000651	格力电器	112,100	5,840,410.00	0.57
28	600900	长江电力	265,700	5,484,048.00	0.54
29	002594	比亚迪	21,200	5,321,200.00	0.52
30	002475	立讯精密	114,100	5,248,600.00	0.52
31	600887	伊利股份	142,100	5,233,543.00	0.51
32	000001	平安银行	226,700	5,127,954.00	0.50
33	00669	创科实业	44,000	4,964,522.11	0.49
34	600030	中信证券	198,800	4,958,072.00	0.49
35	000725	京东方 A	791,600	4,939,584.00	0.49
36	02331	李宁	59,500	4,693,430.45	0.46
37	03988	中国银行	1,958,000	4,545,503.27	0.45
38	300015	爱尔眼科	63,199	4,485,865.02	0.44
39	601398	工商银行	818,800	4,233,196.00	0.42
40	02020	安踏体育用品	27,000	4,106,814.05	0.40
41	01211	比亚迪股份	21,000	4,057,388.50	0.40
42	600031	三一重工	138,800	4,034,916.00	0.40
43	000568	泸州老窖	17,000	4,010,980.00	0.39
44	600309	万华化学	36,600	3,982,812.00	0.39
45	603288	海天味业	29,828	3,846,320.60	0.38
46	603501	韦尔股份	11,900	3,831,800.00	0.38
47	000002	万科 A	159,000	3,785,790.00	0.37
48	600809	山西汾酒	8,400	3,763,200.00	0.37
49	02382	舜宇光学科技	18,400	3,757,140.75	0.37
50	002714	牧原股份	61,500	3,740,430.00	0.37
51	06160	百济神州	20,000	3,514,705.92	0.35
52	300122	智飞生物	18,600	3,473,178.00	0.34
53	02313	申洲国际集团	21,200	3,459,222.83	0.34
54	601919	中远海控	112,700	3,441,858.00	0.34
55	00016	新鸿基地产	35,500	3,417,643.79	0.34
56	002142	宁波银行	84,400	3,289,068.00	0.32
57	600436	片仔癀	7,300	3,272,590.00	0.32
58	00001	长和	64,000	3,221,813.76	0.32
59	06098	Country Garden Services Holdings Co Ltd	46,000	3,211,329.55	0.32

60	00002	CLPHOLDINGSLTD	49,500	3,163,235.33	0.31
61	601328	交通银行	642,800	3,149,720.00	0.31
62	601899	紫金矿业	322,400	3,124,056.00	0.31
63	00883	中国海洋	419,000	3,078,504.62	0.30
64	300782	卓胜微	5,640	3,031,500.00	0.30
65	002352	顺丰控股	42,700	2,890,790.00	0.28
66	002304	洋河股份	13,900	2,880,080.00	0.28
67	00175	吉利汽车	141,000	2,868,554.20	0.28
68	002812	恩捷股份	12,200	2,856,020.00	0.28
69	002230	科大讯飞	41,600	2,811,328.00	0.28
70	00027	银河娱乐	54,000	2,792,543.69	0.27
71	06618	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	30,050	2,782,945.65	0.27
72	300014	亿纬锂能	26,600	2,764,538.00	0.27
73	300274	阳光电源	23,900	2,749,934.00	0.27
74	600000	XD 浦发银	273,900	2,739,000.00	0.27
75	600438	通威股份	63,200	2,734,664.00	0.27
76	01113	长实集团	61,000	2,720,568.77	0.27
77	01801	信达生物	36,000	2,712,414.38	0.27
78	300124	汇川技术	36,150	2,684,499.00	0.26
79	09633	NONGFU SPRING CO LTD-H	82,800	2,683,507.92	0.26
80	000661	长春高新	6,900	2,670,300.00	0.26
81	00003	HONGKONG&CHINAGAS	264,950	2,658,742.73	0.26
82	02319	中国蒙牛	68,000	2,656,498.61	0.26
83	600837	海通证券	225,500	2,593,250.00	0.26
84	000100	TCL 科技	328,400	2,512,260.00	0.25
85	601816	京沪高铁	458,400	2,424,936.00	0.24
86	000063	中兴通讯	71,900	2,389,237.00	0.24
87	002241	歌尔股份	55,700	2,380,618.00	0.23
88	00011	恒生银行	18,300	2,361,717.63	0.23
89	02688	新奥能源	18,900	2,324,348.91	0.23
90	00291	华润创业	40,000	2,321,503.20	0.23
91	300347	泰格医药	12,000	2,319,600.00	0.23
92	601601	中国太保	79,800	2,311,806.00	0.23
93	01109	华润置地	88,000	2,302,864.61	0.23
94	600690	海尔智家	88,800	2,300,808.00	0.23
95	600585	海螺水泥	56,000	2,298,800.00	0.23
96	603986	兆易创新	12,180	2,288,622.00	0.23
97	002271	东方雨虹	41,300	2,284,716.00	0.22
98	02628	中国人寿	178,000	2,280,897.70	0.22
99	601668	中国建筑	490,100	2,278,965.00	0.22
100	002460	赣锋锂业	18,800	2,276,492.00	0.22
101	603799	华友钴业	19,800	2,261,160.00	0.22

102	002027	分众传媒	240,000	2,258,400.00	0.22
103	300142	沃森生物	36,500	2,252,050.00	0.22
104	02388	中银香港	101,500	2,225,418.76	0.22
105	600763	通策医疗	5,400	2,219,400.00	0.22
106	00981	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	111,500	2,217,368.39	0.22
107	600016	民生银行	496,500	2,189,565.00	0.22
108	01093	石药集团	228,000	2,132,388.06	0.21
109	01928	金沙中国	77,200	2,100,536.04	0.21
110	600196	复星医药	28,400	2,048,492.00	0.20
111	601288	农业银行	671,200	2,033,736.00	0.20
112	600048	保利地产	168,100	2,023,924.00	0.20
113	600703	三安光电	62,900	2,015,945.00	0.20
114	00386	中国石化	608,000	1,988,205.24	0.20
115	000338	潍柴动力	110,400	1,972,848.00	0.19
116	01177	中国生物制药	310,000	1,965,539.38	0.19
117	600919	江苏银行	275,400	1,955,340.00	0.19
118	002129	中环股份	49,900	1,926,140.00	0.19
119	601229	上海银行	231,884	1,901,448.80	0.19
120	601688	华泰证券	120,200	1,899,160.00	0.19
121	00868	信义玻璃	72,000	1,896,143.90	0.19
122	600050	中国联通	434,200	1,875,744.00	0.18
123	00268	金蝶国际	84,000	1,841,725.87	0.18
124	600660	福耀玻璃	32,600	1,820,710.00	0.18
125	600570	恒生电子	19,500	1,818,375.00	0.18
126	601211	国泰君安	105,500	1,808,270.00	0.18
127	600104	上汽集团	81,700	1,794,949.00	0.18
128	03328	交通银行	412,000	1,789,504.53	0.18
129	688111	金山办公	4,500	1,776,600.00	0.17
130	00968	信义光能	126,000	1,757,153.26	0.17
131	601766	中国中车	283,500	1,723,680.00	0.17
132	601169	北京银行	346,100	1,685,507.00	0.17
133	002371	北方华创	6,000	1,664,280.00	0.16
134	01997	峻凌国际	44,000	1,653,010.13	0.16
135	600999	招商证券	86,700	1,649,034.00	0.16
136	00066	港铁公司	45,500	1,637,429.43	0.16
137	00960	龙湖地产	45,000	1,628,796.60	0.16
138	01288	农业银行	719,000	1,615,316.90	0.16
139	600019	宝钢股份	208,000	1,589,120.00	0.16
140	002049	紫光国微	10,300	1,588,157.00	0.16
141	002311	海大集团	19,400	1,583,040.00	0.16
142	06969	思摩尔国际	44,000	1,576,125.94	0.16
143	00857	中国石油	500,000	1,572,631.20	0.15

144	00853	微创医疗	27,000	1,564,768.04	0.15
145	01918	融创中国控股	69,000	1,530,070.31	0.15
146	002410	广联达	22,300	1,520,860.00	0.15
147	601988	中国银行	492,200	1,515,976.00	0.15
148	600406	国电南瑞	65,080	1,512,459.20	0.15
149	00688	中国海外发展	103,000	1,511,822.79	0.15
150	02007	碧桂园	208,000	1,505,731.97	0.15
151	601088	中国神华	77,000	1,503,040.00	0.15
152	300498	温氏股份	104,400	1,500,228.00	0.15
153	06186	CHINA FEIHE LTD	107,000	1,492,185.71	0.15
154	300601	康泰生物	10,000	1,490,000.00	0.15
155	601818	XD 光大银	386,400	1,460,592.00	0.14
156	00006	HONGKONGELECTRICHOLDINGS	36,500	1,447,174.34	0.14
157	300450	先导智能	23,880	1,436,143.20	0.14
158	00267	中信股份	206,000	1,434,688.98	0.14
159	00241	中信 21 世纪	100,000	1,432,841.76	0.14
160	600745	闻泰科技	14,400	1,395,360.00	0.14
161	300759	康龙化成	6,400	1,388,736.00	0.14
162	000625	长安汽车	52,700	1,384,956.00	0.14
163	600028	中国石化	311,500	1,358,140.00	0.13
164	000538	云南白药	11,700	1,353,924.00	0.13
165	02601	中国太平洋保险	65,600	1,334,589.75	0.13
166	600893	航发动力	25,000	1,329,750.00	0.13
167	600009	上海机场	27,500	1,323,575.00	0.13
168	601628	中国人寿	38,800	1,314,932.00	0.13
169	00992	联想集团	176,000	1,307,763.49	0.13
170	09992	泡泡玛特	20,400	1,307,031.26	0.13
171	002821	凯莱英	3,500	1,304,100.00	0.13
172	600346	恒力石化	49,500	1,298,880.00	0.13
173	300454	深信服	5,000	1,297,400.00	0.13
174	601658	邮储银行	254,000	1,275,080.00	0.13
175	600588	用友网络	38,236	1,271,729.36	0.13
176	300896	爱美客	1,600	1,262,208.00	0.12
177	601633	长城汽车	28,600	1,246,674.00	0.12
178	601390	中国中铁	237,100	1,242,404.00	0.12
179	00017	NEWWORLDEVELOPMENT	37,000	1,242,253.84	0.12
180	601009	南京银行	117,200	1,232,944.00	0.12
181	01658	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	281,000	1,222,849.73	0.12
182	002493	荣盛石化	70,450	1,216,671.50	0.12
183	688036	传音控股	5,800	1,215,100.00	0.12
184	300595	欧普康视	11,700	1,211,535.00	0.12
185	00586	海螺创业	44,500	1,210,801.21	0.12

186	601377	兴业证券	124,900	1,206,534.00	0.12
187	601857	中国石油	227,700	1,204,533.00	0.12
188	06690	海尔智家	53,200	1,199,626.38	0.12
189	600132	重庆啤酒	5,900	1,167,905.00	0.11
190	300413	芒果超媒	16,600	1,138,760.00	0.11
191	00012	HENDERSONLANDDEVELOPMENT	37,000	1,132,960.13	0.11
192	600089	特变电工	86,900	1,116,665.00	0.11
193	601225	陕西煤业	93,400	1,106,790.00	0.11
194	600584	长电科技	29,300	1,104,024.00	0.11
195	01821	ESR	50,600	1,103,105.10	0.11
196	01833	银泰百货商店	13,700	1,102,331.26	0.11
197	00914	海螺水泥	32,000	1,097,014.27	0.11
198	603882	金域医学	6,800	1,086,436.00	0.11
199	01066	山东威高	72,000	1,085,564.85	0.11
200	300408	三环集团	25,500	1,081,710.00	0.11
201	002601	龙佰集团	31,200	1,078,896.00	0.11
202	688012	中微公司	6,500	1,078,480.00	0.11
203	600426	华鲁恒升	34,460	1,066,537.00	0.10
204	600111	北方稀土	50,600	1,047,420.00	0.10
205	000776	广发证券	69,100	1,046,174.00	0.10
206	00384	中国燃气	53,000	1,045,175.69	0.10
207	601939	建设银行	156,600	1,041,390.00	0.10
208	06666	EVERGRANDE PROPERTY SERVICES	128,000	1,038,435.84	0.10
209	601100	恒立液压	12,000	1,031,040.00	0.10
210	002001	新 和 成	35,900	1,029,612.00	0.10
211	600926	杭州银行	69,800	1,029,550.00	0.10
212	000895	双汇发展	32,300	1,027,140.00	0.10
213	01088	中国神华	81,000	1,025,804.87	0.10
214	300433	蓝思科技	34,700	1,020,527.00	0.10
215	002050	三花智控	42,000	1,007,160.00	0.10
216	002841	视源股份	8,100	1,006,749.00	0.10
217	002179	中航光电	12,700	1,003,554.00	0.10
218	00288	万洲国际	172,500	1,001,865.92	0.10
219	300661	圣邦股份	3,950	998,283.50	0.10
220	600600	青岛啤酒	8,600	994,590.00	0.10
221	03888	金山软件	25,400	983,826.43	0.10
222	000166	申万宏源	209,500	980,460.00	0.10
223	00788	中国铁塔	1,092,000	972,235.56	0.10
224	600958	东方证券	97,200	971,028.00	0.10
225	600741	华域汽车	36,800	966,736.00	0.10
226	300003	乐普医疗	29,800	957,176.00	0.09
227	02328	中国财险	168,000	950,568.19	0.09

228	000963	华东医药	20,500	943,205.00	0.09
229	00881	中升控股	17,500	940,666.44	0.09
230	002007	华兰生物	25,600	939,008.00	0.09
231	00083	信和置业	92,000	936,988.65	0.09
232	603806	福斯特	8,900	935,657.00	0.09
233	01193	华润燃气	24,000	930,598.27	0.09
234	000786	北新建材	23,700	930,225.00	0.09
235	00909	明源云	29,000	930,223.84	0.09
236	06862	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	27,000	918,865.94	0.09
237	000157	中联重科	98,600	911,064.00	0.09
238	03692	HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	32,000	905,303.04	0.09
239	002607	中公教育	43,100	900,359.00	0.09
240	601901	方正证券	95,700	895,752.00	0.09
241	02202	万科	44,300	895,725.80	0.09
242	601336	新华保险	19,500	895,245.00	0.09
243	601233	桐昆股份	37,100	893,739.00	0.09
244	00772	CHINA LITERATURE LTD	12,400	890,941.34	0.09
245	002236	大华股份	42,100	888,310.00	0.09
246	600015	华夏银行	143,300	887,027.00	0.09
247	00004	玖龙仓集团	36,000	886,664.45	0.09
248	600143	金发科技	42,300	882,378.00	0.09
249	601155	新城控股	21,200	881,920.00	0.09
250	601989	中国重工	213,600	880,032.00	0.09
251	00101	HANGLUNGPROPERTIESLTD	56,000	878,809.61	0.09
252	06030	中信证券	54,000	875,281.59	0.09
253	600176	中国巨石	56,094	870,017.94	0.09
254	601138	工业富联	70,100	869,941.00	0.09
255	603993	洛阳钼业	165,900	856,044.00	0.08
256	600029	南方航空	142,000	854,840.00	0.08
257	300529	健帆生物	9,800	846,328.00	0.08
258	000768	中航西飞	32,200	846,216.00	0.08
259	02018	瑞声科技	17,500	846,017.34	0.08
260	601877	正泰电器	25,300	844,514.00	0.08
261	600352	浙江龙盛	60,700	834,018.00	0.08
262	600760	中航沈飞	13,729	827,858.70	0.08
263	01876	百威亚太	40,600	827,669.98	0.08
264	600010	宝钢股份	533,500	826,925.00	0.08
265	601788	光大证券	46,100	824,729.00	0.08
266	600547	山东黄金	42,300	813,006.00	0.08
267	00728	中国电信	334,000	808,731.84	0.08
268	001979	招商蛇口	73,700	807,015.00	0.08
269	601600	中国铝业	152,100	806,130.00	0.08

270	601186	中国铁建	107,700	800,211.00	0.08
271	002008	大族激光	19,800	799,722.00	0.08
272	603369	今世缘	14,600	790,736.00	0.08
273	002202	金风科技	64,600	785,536.00	0.08
274	002185	华天科技	51,000	784,890.00	0.08
275	300999	金龙鱼	9,200	781,632.00	0.08
276	01044	恒安国际	18,000	778,826.88	0.08
277	601916	浙商银行	195,200	774,944.00	0.08
278	000876	新希望	52,600	771,642.00	0.08
279	601799	星宇股份	3,400	767,448.00	0.08
280	01691	J S 环球生活	42,000	763,599.82	0.08
281	603899	晨光文具	9,000	761,040.00	0.07
282	01378	中国宏桥	86,500	757,176.16	0.07
283	688169	石头科技	600	756,600.00	0.07
284	00998	中信银行	247,000	756,327.44	0.07
285	01038	CHEUNGKONGINFRASTRUCTURE	19,500	751,243.43	0.07
286	00270	粤海投资	80,000	742,881.02	0.07
287	002555	三七互娱	30,900	742,218.00	0.07
288	01209	华润万象生活	16,600	734,135.86	0.07
289	003816	中国广核	274,400	732,648.00	0.07
290	000938	紫光股份	33,300	728,604.00	0.07
291	03323	中国建材	96,000	728,502.68	0.07
292	002736	国信证券	67,500	725,625.00	0.07
293	00322	康师傅控股	56,000	722,245.44	0.07
294	00285	比亚迪电子	17,000	721,413.36	0.07
295	01114	华晨中国汽车	118,000	716,753.71	0.07
296	601066	中信建投	22,800	716,604.00	0.07
297	603160	汇顶科技	5,500	712,965.00	0.07
298	600109	国金证券	56,100	711,909.00	0.07
299	000069	华侨城 A	95,400	709,776.00	0.07
300	00522	ASMPACIFICTECHNOLOGY	8,000	700,278.53	0.07
301	600989	宝丰能源	51,100	699,048.00	0.07
302	300136	信维通信	22,600	697,888.00	0.07
303	000425	徐工机械	109,500	697,515.00	0.07
304	601669	中国电建	179,100	693,117.00	0.07
305	600150	中国船舶	41,700	688,467.00	0.07
306	603659	璞泰来	5,040	688,464.00	0.07
307	688008	澜起科技	10,900	679,942.00	0.07
308	00425	敏实集团	22,000	675,482.54	0.07
309	000977	浪潮信息	24,000	675,120.00	0.07
310	000596	古井贡酒	2,800	670,600.00	0.07
311	002384	东山精密	31,900	664,796.00	0.07

312	300677	英科医疗	5,300	661,440.00	0.07
313	000783	长江证券	90,100	659,532.00	0.06
314	00151	中国旺旺控股	144,000	659,007.36	0.06
315	603019	中科曙光	23,800	657,118.00	0.06
316	03908	中金公司	37,600	653,881.75	0.06
317	002624	完美世界	27,300	652,743.00	0.06
318	601238	广汽集团	50,400	652,680.00	0.06
319	300146	汤臣倍健	19,800	651,420.00	0.06
320	300558	贝达药业	6,000	649,440.00	0.06
321	300253	卫宁健康	39,700	645,919.00	0.06
322	600079	人福医药	22,800	644,556.00	0.06
323	00135	昆仑能源	108,000	643,430.82	0.06
324	601838	成都银行	50,500	638,320.00	0.06
325	600183	生益科技	26,900	629,729.00	0.06
326	002405	四维图新	42,700	627,690.00	0.06
327	600886	国投电力	65,100	625,611.00	0.06
328	603833	欧派家居	4,400	624,624.00	0.06
329	603517	绝味食品	7,400	623,746.00	0.06
330	688185	康希诺	800	622,216.00	0.06
331	600298	安琪酵母	11,400	619,932.00	0.06
332	601985	中国核电	122,100	617,826.00	0.06
333	000703	恒逸石化	51,500	615,425.00	0.06
334	601108	财通证券	58,400	612,616.00	0.06
335	300144	宋城演艺	36,400	611,520.00	0.06
336	002600	领益智造	66,500	611,135.00	0.06
337	601360	三六零	49,900	609,279.00	0.06
338	002414	高德红外	22,040	607,863.20	0.06
339	01579	颐海国际	14,000	607,501.61	0.06
340	300676	华大基因	5,100	604,860.00	0.06
341	601555	东吴证券	72,260	602,648.40	0.06
342	002791	坚朗五金	3,100	601,555.00	0.06
343	600219	南山铝业	167,000	601,200.00	0.06
344	000066	中国长城	41,100	600,060.00	0.06
345	603816	顾家家居	7,700	595,056.00	0.06
346	00019	SWIREPACIFIC LTD 'A'	13,500	591,421.66	0.06
347	603589	口子窖	8,700	588,903.00	0.06
348	002044	美年健康	64,600	588,506.00	0.06
349	002252	上海莱士	78,300	586,467.00	0.06
350	300033	同花顺	5,200	586,456.00	0.06
351	601077	渝农商行	145,200	579,348.00	0.06
352	002938	鹏鼎控股	16,100	577,668.00	0.06
353	00345	维他奶国际	24,000	576,132.19	0.06

354	600522	中天科技	57,500	575,000.00	0.06
355	601607	上海医药	27,100	572,623.00	0.06
356	000728	国元证券	71,200	567,464.00	0.06
357	002602	世纪华通	87,800	563,676.00	0.06
358	600332	白云山	16,400	555,140.00	0.05
359	00813	世茂房地产	35,000	554,498.11	0.05
360	00656	复星国际	59,500	553,507.94	0.05
361	300628	亿联网络	6,600	553,080.00	0.05
362	600845	宝信软件	10,850	552,265.00	0.05
363	601966	玲珑轮胎	12,600	551,124.00	0.05
364	600362	江西铜业	24,500	548,310.00	0.05
365	600161	天坛生物	16,000	548,000.00	0.05
366	600383	金地集团	52,800	540,672.00	0.05
367	002422	科伦药业	27,100	540,645.00	0.05
368	601111	中国国航	69,400	539,932.00	0.05
369	01972	太古地产	28,000	539,354.26	0.05
370	600872	中炬高新	12,800	537,856.00	0.05
371	601800	中国交建	82,200	532,656.00	0.05
372	603444	吉比特	1,000	530,000.00	0.05
373	600115	中国东航	104,300	529,844.00	0.05
374	01516	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	22,000	528,121.18	0.05
375	002385	大北农	77,000	523,600.00	0.05
376	002916	深南电路	4,700	522,311.00	0.05
377	00762	中国联通	148,000	522,146.84	0.05
378	002024	苏宁易购	93,200	520,988.00	0.05
379	00884	徐辉控股	102,000	514,325.29	0.05
380	300308	中际旭创	13,200	508,464.00	0.05
381	601727	上海电气	119,600	507,104.00	0.05
382	002508	老板电器	10,900	506,850.00	0.05
383	600061	国投资本	59,572	505,766.28	0.05
384	601117	中国化学	57,300	501,948.00	0.05
385	000860	顺鑫农业	11,900	501,942.00	0.05
386	601021	春秋航空	8,800	500,720.00	0.05
387	601618	中国中冶	167,000	497,660.00	0.05
388	000708	中信特钢	23,600	491,824.00	0.05
389	601162	天风证券	100,600	488,916.00	0.05
390	603939	益丰药房	8,690	487,422.10	0.05
391	06110	滔搏	46,000	486,866.65	0.05
392	600699	均胜电子	19,000	484,880.00	0.05
393	600705	中航产融	124,700	482,589.00	0.05
394	01988	民生银行	155,500	481,325.00	0.05
395	002180	纳思达	14,900	479,780.00	0.05

396	601878	浙商证券	36,100	472,188.00	0.05
397	600606	绿地控股	85,500	465,975.00	0.05
398	002064	华峰化学	32,200	457,240.00	0.04
399	601990	南京证券	43,300	455,516.00	0.04
400	002013	中航机电	45,200	455,164.00	0.04
401	00817	方兴地产(中国)有限公司	210,000	454,315.68	0.04
402	002127	南极电商	46,200	451,374.00	0.04
403	002456	欧菲光	50,100	444,888.00	0.04
404	002157	正邦科技	36,800	439,760.00	0.04
405	002463	沪电股份	28,400	439,348.00	0.04
406	600011	华能国际	103,700	437,614.00	0.04
407	000656	金科股份	75,200	435,408.00	0.04
408	01313	华润水泥控股	70,000	429,852.53	0.04
409	600521	华海药业	20,500	428,040.00	0.04
410	600177	雅戈尔	64,900	427,691.00	0.04
411	601933	XD 永辉超	89,600	423,808.00	0.04
412	00836	华润电力	48,000	423,362.30	0.04
413	002299	圣农发展	17,600	420,288.00	0.04
414	603392	万泰生物	1,600	414,688.00	0.04
415	03333	恒大地产集团	49,000	412,611.83	0.04
416	600536	中国软件	7,200	409,896.00	0.04
417	000050	深天马A	28,900	409,802.00	0.04
418	601696	中银证券	19,500	401,505.00	0.04
419	600848	上海临港	22,380	400,602.00	0.04
420	601216	君正集团	78,700	400,583.00	0.04
421	00880	澳博控股	56,000	395,138.15	0.04
422	600118	中国卫星	13,500	395,010.00	0.04
423	601995	中金公司	6,400	393,600.00	0.04
424	06993	蓝月亮集团	43,000	392,858.25	0.04
425	01929	周大福	26,600	392,645.24	0.04
426	600489	中金黄金	45,494	392,158.28	0.04
427	600066	宇通客车	31,268	390,537.32	0.04
428	01128	WYNNMACAULTD	38,400	390,451.88	0.04
429	03380	龙光地产	40,000	386,750.78	0.04
430	603195	公牛集团	1,900	383,800.00	0.04
431	600018	上港集团	80,400	383,508.00	0.04
432	002558	巨人网络	28,800	383,040.00	0.04
433	600369	西南证券	78,500	382,295.00	0.04
434	02689	玖龙纸业	46,000	381,225.77	0.04
435	01030	新城发展控股	62,000	379,694.75	0.04
436	600038	中直股份	7,100	374,454.00	0.04
437	00966	中国太平	34,800	374,116.48	0.04

438	00008	PCCWLTD	110,000	372,522.22	0.04
439	002120	韵达股份	27,300	369,369.00	0.04
440	601998	中信银行	72,200	368,220.00	0.04
441	002373	千方科技	22,000	367,400.00	0.04
442	300383	光环新网	25,500	366,945.00	0.04
443	002926	华西证券	37,000	356,310.00	0.04
444	02282	美高梅中国	36,400	356,183.49	0.04
445	601198	东兴证券	32,400	354,132.00	0.03
446	601872	招商轮船	75,800	350,196.00	0.03
447	688126	沪硅产业	12,000	350,160.00	0.03
448	603338	浙江鼎力	5,900	346,271.00	0.03
449	688009	中国通号	60,600	344,814.00	0.03
450	002065	东华软件	43,400	344,162.00	0.03
451	002673	西部证券	41,500	342,375.00	0.03
452	601319	中国人保	57,500	340,975.00	0.03
453	00144	招商局国际	36,000	339,688.34	0.03
454	002294	信立泰	10,200	335,580.00	0.03
455	03383	雅居乐集团	40,000	334,828.99	0.03
456	600895	张江高科	18,200	332,514.00	0.03
457	601881	中国银河	30,100	324,478.00	0.03
458	600188	兖州煤业	20,900	321,024.00	0.03
459	603658	安图生物	4,233	320,734.41	0.03
460	601865	福莱特	8,100	320,193.00	0.03
461	300251	光线传媒	28,000	302,680.00	0.03
462	600233	圆通速递	30,100	301,301.00	0.03
463	600372	中航电子	17,800	294,590.00	0.03
464	603233	大参林	5,760	294,393.60	0.03
465	600498	烽火通信	15,700	292,491.00	0.03
466	603707	健友股份	6,900	288,075.00	0.03
467	002146	荣盛发展	51,000	287,640.00	0.03
468	00392	北京控股	12,500	286,547.55	0.03
469	03808	中国重汽	20,500	283,839.13	0.03
470	603866	桃李面包	9,060	282,672.00	0.03
471	600801	华新水泥	15,600	274,092.00	0.03
472	02588	中银航空租赁	5,000	272,506.20	0.03
473	01813	合景泰富	31,000	268,262.59	0.03
474	600027	华电国际	77,300	265,912.00	0.03
475	000961	中南建设	44,600	264,032.00	0.03
476	002032	苏泊尔	4,000	255,160.00	0.03
477	601577	长沙银行	28,500	254,790.00	0.03
478	002153	石基信息	10,800	253,908.00	0.02
479	601231	环旭电子	15,100	253,831.00	0.02

480	600025	华能水电	42,800	247,812.00	0.02
481	000987	越秀金控	19,500	246,870.00	0.02
482	002939	长城证券	21,800	242,634.00	0.02
483	600340	华夏幸福	46,200	242,088.00	0.02
484	000800	一汽解放	21,800	235,876.00	0.02
485	601236	红塔证券	17,100	231,876.00	0.02
486	06808	SunArtRetailGroupLtd (HongKong)	46,500	223,638.14	0.02
487	002773	康弘药业	9,000	208,170.00	0.02
488	601456	国联证券	13,500	207,900.00	0.02
489	601808	中海油服	13,400	192,424.00	0.02
490	600918	中泰证券	17,700	191,514.00	0.02
491	00293	CATHAYPACIFICAIRWAYS	33,000	180,128.68	0.02
492	601698	中国卫通	10,500	169,995.00	0.02
493	300866	安克创新	1,000	167,470.00	0.02
494	603087	甘李药业	1,500	159,870.00	0.02
495	300888	稳健医疗	1,200	148,344.00	0.01
496	688180	君实生物	1,800	146,178.00	0.01
497	300832	新产业	1,900	117,040.00	0.01
498	600299	安迪苏	9,400	112,424.00	0.01
499	002901	大博医疗	1,100	80,179.00	0.01
500	300869	康泰医学	1,000	70,820.00	0.01

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	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.01
2	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
3	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
4	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
5	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
6	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
7	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
8	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
9	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
10	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
11	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
12	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
13	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
14	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
15	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
16	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
17	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00

18	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
19	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
20	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
21	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
22	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
23	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
24	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
25	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
26	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
27	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
28	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
29	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
30	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
31	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
32	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
33	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
34	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
35	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
36	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
37	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
38	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
39	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
40	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	143,650,438.80	14.13
2	03690	美团-W	57,396,488.94	5.65
3	600519	贵州茅台	52,697,289.52	5.18
4	01299	友邦保险	36,414,447.82	3.58
5	601318	中国平安	32,208,415.98	3.17
6	00005	汇丰控股	28,037,775.77	2.76
7	600036	招商银行	23,945,849.00	2.36
8	00939	建设银行	22,366,567.42	2.20
9	000858	五粮液	21,510,071.92	2.12
10	02318	中国平安	20,852,542.38	2.05
11	00388	香港交易所	19,650,619.27	1.93
12	000333	美的集团	16,894,227.46	1.66
13	300750	宁德时代	16,465,560.52	1.62
14	01810	小米集团-W	14,330,466.82	1.41
15	600276	恒瑞医药	14,077,839.90	1.38

16	601166	兴业银行	13,688,592.00	1.35
17	01398	工商银行	13,220,676.00	1.30
18	601888	中国中免	11,860,810.00	1.17
19	601012	隆基股份	11,147,275.06	1.10
20	000651	格力电器	10,449,508.00	1.03

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	41,959,739.76	4.13
2	01299	友邦保险	12,101,514.78	1.19
3	03690	美团-W	10,794,535.95	1.06
4	00005	汇丰控股	9,862,447.75	0.97
5	00939	建设银行	7,804,864.89	0.77
6	000858	五粮液	6,888,198.42	0.68
7	02318	中国平安	6,167,581.69	0.61
8	00388	香港交易所	5,657,348.89	0.56
9	000333	美的集团	5,032,655.58	0.50
10	01398	工商银行	4,581,165.31	0.45
11	300750	宁德时代	4,340,720.82	0.43
12	03968	招商银行	4,030,135.54	0.40
13	300760	迈瑞医疗	3,881,300.00	0.38
14	000651	格力电器	3,601,759.62	0.35
15	01810	小米集团-W	3,401,780.93	0.33
16	02269	药明生物	3,185,224.26	0.31
17	300059	东方财富	3,086,782.10	0.30
18	00941	中国移动	3,016,935.26	0.30
19	000001	平安银行	2,853,690.28	0.28
20	00002	中电控股	2,819,125.82	0.28

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	1,531,411,395.83
卖出股票收入（成交）总额	359,674,739.99

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	217,378.19
2	应收证券清算款	7,047,665.67
3	应收股利	2,516,413.63
4	应收利息	7,743.66
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,789,201.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301006	迈拓股份	125,719.39	0.01	新发流通受限
2	300979	华利集团	80,937.50	0.01	新发流通受限
3	300981	中红医疗	54,324.39	0.01	新发流通受限
4	301020	密封科技	44,794.40	0.00	新股流通受限
5	300973	立高食品	41,655.60	0.00	新发流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
27,055	39,282.68	19,039,300.00	1.79	1,043,753,700.00	98.21

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	竞技世界（北京）网络技术有限公司	5,000,000.00	0.47
2	中信建投证券股份有限公司	3,188,200.00	0.30
3	方正证券股份有限公司	3,142,300.00	0.30
4	四川省宜宾晶鹏玻璃制品有限公司	3,000,000.00	0.28
5	周勇	3,000,000.00	0.28
6	王东博	3,000,000.00	0.28
7	那秀影	3,000,000.00	0.28

8	但钧	3,000,000.00	0.28
9	郑碧珍	3,000,000.00	0.28
10	唐振荣	3,000,000.00	0.28

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（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	1,482,793,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	425,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,062,793,000.00

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券股份有限公司	2	85,879,629.20	4.54%	62,804.70	4.36%	—
中信建投证券股份有限公司	4	78,801,159.73	4.17%	57,627.43	4.00%	—
华西证券股份有限公司	4	443,979,983.57	23.50%	324,681.26	22.56%	—
华泰证券有限责任公司	4	1,280,893,407.63	67.79%	994,358.45	69.08%	—
德邦证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
东方财富	2	—	—	—	—	—

证券股份 有限公司						
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华龙证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
川财证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
开源证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申港证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中国国际 金融有限 公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
------------	--	--	--	--	--	--

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

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

3、本基金合同生效日 2021 年 2 月 4 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
川财证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
开源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申港证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
2	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
3	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
4	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》	中国证券报	2021-01-14
5	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
6	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
7	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金新增网下现金发售代理机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-18
8	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额上网发售提示性公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-26
9	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金设置最高募集规模上限的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
10	《银华基金管理股份有限公司关于银	本基金管理人网站, 中	2021-02-05

	华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效的公告》	国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
12	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
13	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告》	中国证券报	2021-03-02
14	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
15	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金做市商的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
17	《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
18	《银华中证沪港深 500 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	2021-03-30
19	《银华中证沪港深 500 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
20	《银华中证沪港深 500 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
21	《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
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-04-27
23	《银华基金管理股份有限公司关于旗	本基金管理人网站, 四	2021-05-17

	下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	
24	《银华中证沪港深 500 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	2021-06-22
25	《银华中证沪港深 500 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	2021-06-22
26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-06-22
27	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资（如有）业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28
28	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、赎回业务的公告》	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	2021-06-28

§ 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

注：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 2021 年 3 月 2 日披露了《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》，本基金自 2021 年 3 月 5 日起开放日常申购、赎回业务。

2、本基金管理人于 2021 年 3 月 16 日披露了《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》，上市地点为上海证券交易所，上市日期为 2021 年 3 月 5 日。

3、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，本次修订自 2021 年 3 月 30 日起正式生效。

4、本基金管理人于 2021 年 6 月 22 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，本基金自 2021 年 6 月 22 日起可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基

金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华中证沪港深 500 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 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华中证沪港深 500 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）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 28 日