

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	48

8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	74
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 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	141,805,582.00 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日）-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	65,538,285.16	192,714,385.94	-21,149,034.94
本期利润	23,475,774.93	173,356,948.47	53,179,234.45
加权平均基金份额本期利润	0.1258	0.3044	0.0290
本期加权平均净值利润率	8.22%	27.53%	2.98%
本期基金	7.43%	40.67%	4.64%

份额净值增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	82,431,904.41	107,998,319.23	-13,482,590.83
期末可供分配基金份额利润	0.5813	0.4720	-0.0100
期末基金资产净值	224,237,486.41	336,803,901.23	1,416,592,836.21
期末基金份额净值	1.5813	1.4720	1.0464
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	58.13%	47.20%	4.64%

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

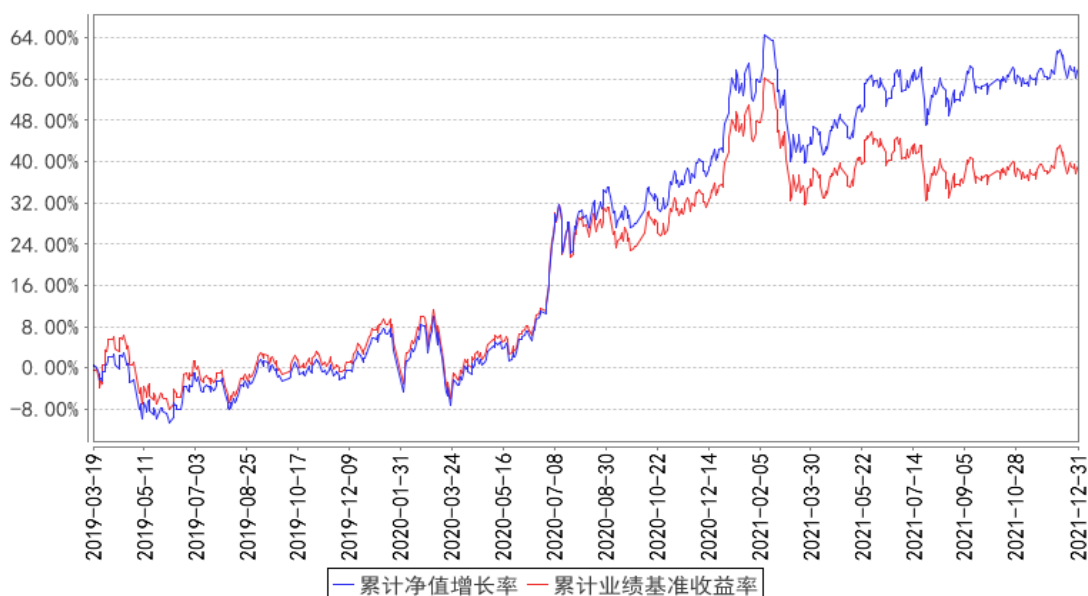
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	2.26%	0.72%	1.57%	0.75%	0.69%	-0.03%
过去六个月	0.25%	0.95%	-3.66%	0.99%	3.91%	-0.04%
过去一年	7.43%	1.13%	-0.40%	1.16%	7.83%	-0.03%

自基金合同生效起至今	58.13%	1.23%	39.21%	1.26%	18.92%	-0.03%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

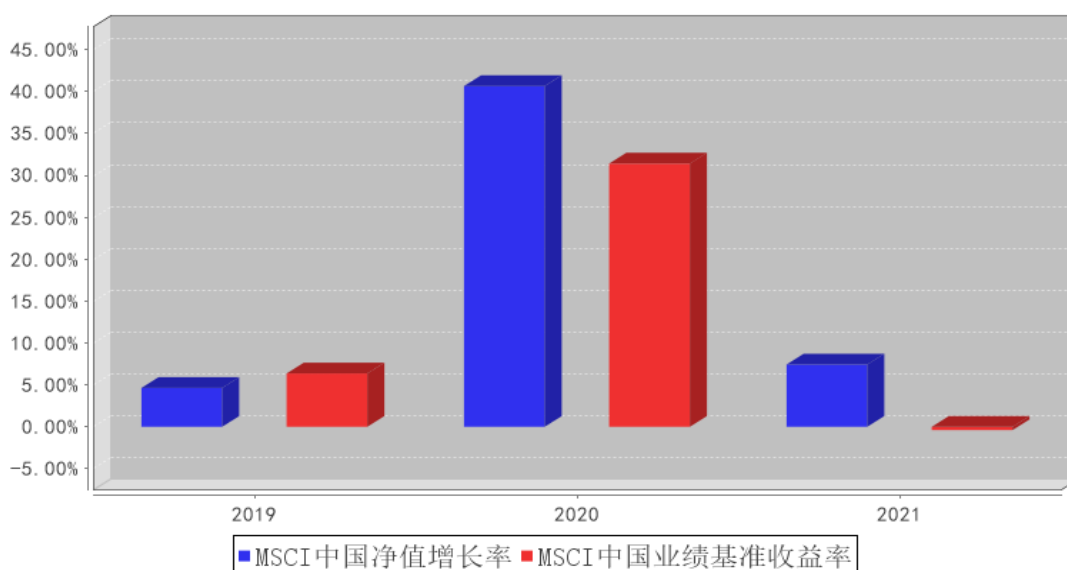
MSCI 中国累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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

MSCI 中国基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2021年、2020年以及2019年3月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于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12月31日，本基金管理人管理着159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、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益

一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。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	-	13.5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，自 2022 年 2 月 18 日起兼任银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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	-	8.0 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、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	-	8.0 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、自 2022 年 2 月 27 日起刘文魁先生不再担任本基金基金经理助理。

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 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制

度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1日内、3日内及5日内）同向交易的交易价差从T检验（置信度为95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次，原因是量化投资组合和指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.5813元；本报告期基金份额净值增长率为7.43%，业绩比较基准收益率为-0.40%。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

宏观经济层面，2021年全球层面的核心主题仍然是在疫情约束下的经济活动复苏。伴随疫苗接种率的提升与变异病毒的更替，全球防疫措施整体呈现放松、反复、收紧的阶段性波动状态。对于海外多数国家而言，阶段性防控收紧和持续性货币宽松成为维持疫情防控与经济活动平衡的主要思路。而对于国内而言，坚持动态清零和货币整体平衡的策略依旧运行良好。在这种差异下，全球通胀率整体提升，中国的出口水平依旧维持在较高位。进入2022年之后，我们认为潜在变化因素仍然在于人类对疫情的认知提升，从而带来疫情约束的宽松。这些变化都将对市场产生影响。

企业估值层面，2021 年全球市场仍是受货币宽松浪潮与通胀提升影响明显。上游资源类、制造类公司估值水平提升明显。国内市场也与之相关联，上游行业的业绩与估值都经历了一次提升，其他行业板块则主要是受政策性、结构性变化的影响。进入 2022 年后，我们认为通胀的影响边际上在减弱，行业性、结构性的影响将会更加主流化。风险层面，我们认为 2022 年的主要风险来自于海外市场风险的传递、全球地缘摩擦事件的发生。基于上述判断，我们认为 A 股市场仍将存在机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了监察稽核机制，根据不同基金的特点与公司业务发展情况，及时界定新的合规风险点，并在年初制定监察稽核工作计划及重点，以专项检查或抽查的形式对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务环节进行检查。

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估

值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的基金管理人——银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P01968 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基

	<p>金的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	郝琪 杨婧
会计师事务所的地址	中国上海
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	9,607,496.09	6,360,723.47
结算备付金		4,531,187.05	639,631.24
存出保证金		1,685,846.53	90,775.27
交易性金融资产	7.4.7.2	209,181,142.46	334,392,157.85
其中：股票投资		209,181,142.46	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,290,804.72	1,982,340.43
应收利息	7.4.7.5	3,309.99	1,003.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		227,299,786.84	343,466,631.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,604,922.25	5,328,409.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		97,120.37	147,035.00
应付托管费		19,424.09	29,407.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	94,916.51	216,017.59
应交税费		7,700.14	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	238,217.07	941,861.58
负债合计		3,062,300.43	6,662,730.40
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	141,805,582.00	228,805,582.00
未分配利润	7.4.7.10	82,431,904.41	107,998,319.23
所有者权益合计		224,237,486.41	336,803,901.23
负债和所有者权益总计		227,299,786.84	343,466,631.63

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5813 元，基金份额总额 141,805,582.00

份。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		26,500,465.86	180,142,894.07
1. 利息收入		67,192.52	61,887.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,192.52	61,803.87
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）		68,088,324.35	197,416,115.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	62,980,683.37	189,667,237.61
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	998,517.47	-
股利收益	7.4.7.16	4,109,123.51	7,748,877.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-42,062,510.23	-19,357,437.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	407,459.22	2,022,328.38
减：二、费用		3,024,690.93	6,785,945.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,431,209.71	3,210,731.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	286,242.03	642,146.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	841,194.49	2,286,006.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支		-	-

出			
6. 税金及附加		3,594.66	0.31
7. 其他费用	7.4.7.20	462,450.04	647,061.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,475,774.93	173,356,948.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,475,774.93	173,356,948.47

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	23,475,774.93	23,475,774.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-87,000,000.00	-49,042,189.75	-136,042,189.75
其中：1. 基金申购款	174,000,000.00	90,804,125.25	264,804,125.25
2. 基金赎回款	-261,000,000.00	-139,846,315.00	-400,846,315.00
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）	141,805,582.00	82,431,904.41	224,237,486.41
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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)	-	173,356,948.47	173,356,948.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,125,000,000.00	-128,145,883.45	-1,253,145,883.45
其中：1. 基金申购款	414,000,000.00	65,516,189.76	479,516,189.76
2. 基金赎回款	-1,539,000,000.00	-193,662,073.21	-1,732,662,073.21
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)	228,805,582.00	107,998,319.23	336,803,901.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

第二层次：输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

1. 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

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

(2) 未上市的股票的估值

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

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值；

(3) 流通受限股票的估值

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2. 债券投资

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

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价

或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

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

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3. 权证投资

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

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4. 分离交易可转债

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

5. 其他

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

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性

金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配；

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

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

(4) 本基金收益分配采取现金分红方式；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	9,607,496.09	6,360,723.47
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	9,607,496.09	6,360,723.47
----	--------------	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	196,509,580.77	209,181,142.46	12,671,561.69
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	196,509,580.77	209,181,142.46	12,671,561.69
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	279,421,325.93	334,392,157.85	54,970,831.92
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	279,421,325.93	334,392,157.85	54,970,831.92

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	10,063,420.00	-	-	
其中：股指期货投资	10,063,420.00	-	-	

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,063,420.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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 12 月 31 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：IF2203 买入持仓量 3 手，合约市值人民币 4,455,540.00 元，公允价值变动人民币 61,680.00 元。IC2203 买入持仓量 4 手，合约市值人民币 5,844,640.00 元，公允价值变动人民币 175,080.00 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,046.89	641.80
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	2,251.22	316.58
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	11.88	44.99
合计	3,309.99	1,003.37

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	94,916.51	216,017.59
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	94,916.51	216,017.59

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	68,217.07	771,861.58
合计	238,217.07	941,861.58

7.4.7.9 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12月31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	174,000,000.00	174,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-261,000,000.00	-261,000,000.00
- 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	141,805,582.00	141,805,582.00

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。

7.4.7.10 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	65,538,285.16	-42,062,510.23	23,475,774.93
本期基金份额交易产生的变动数	-62,029,661.14	12,987,471.39	-49,042,189.75
其中：基金申购款	121,519,483.74	-30,715,358.49	90,804,125.25

基金赎回款	-183,549,144.88	43,702,829.88	-139,846,315.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,401,684.91	-35,969,780.50	82,431,904.41

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	41,196.32	47,254.76
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	25,423.34	12,679.44
其他	572.86	1,869.67
合计	67,192.52	61,803.87

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	47,301,025.62	160,355,922.78
股票投资收益——赎回差价收入	15,679,657.75	29,311,314.83
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	62,980,683.37	189,667,237.61

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	305,870,112.93	958,886,797.64
减：卖出股票成本总额	258,569,087.31	798,530,874.86

买卖股票差价收入	47,301,025.62	160,355,922.78
----------	---------------	----------------

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	400,846,315.00	1,732,662,073.21
减：现金支付赎回款总额	186,106,162.00	771,517,647.21
减：赎回股票成本总额	199,060,495.25	931,833,111.17
赎回差价收入	15,679,657.75	29,311,314.83

7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	998,517.47	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,109,123.51	7,748,877.82
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	4,109,123.51	7,748,877.82

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-42,299,270.23	-19,357,437.47
股票投资	-42,299,270.23	-19,357,437.47
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	236,760.00	-
权证投资	-	-
期货投资	236,760.00	-
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	-42,062,510.23	-19,357,437.47

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	407,459.22	2,022,328.38
合计	407,459.22	2,022,328.38

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	841,194.49	2,286,006.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	841,194.49	2,286,006.94

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日

审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	732.00	757.00
指数使用费	141,718.04	326,304.02
其他	150,000.00	150,000.00
合计	462,450.04	647,061.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司
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(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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,431,209.71	3,210,731.10
其中：支付销售机构的客户维护费	23,270.07	49,205.31

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	286,242.03	642,146.23

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31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	24,188,200.00	17.06	21,341,700.00	9.33

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	9,607,496.09	41,196.32	6,360,723.47	47,254.76

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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）268,768.00 股，期末公允价值为人民币 1,244,395.84 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.55%。

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）17,582.00 股，期末公允价值为人民币 128,700.24 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）9,893.00 股，期末公允价值为人民币 86,860.54 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.04%。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-

301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年02月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,153	8,024.88	14,424.03	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年02月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-

			日								
301063	海锅股份	2021年 9月9日	2022年 3月24日	新股流 通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	
301066	万事利	2021年 9月13日	2022年 3月22日	新股流 通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
301068	大地海洋	2021年 9月16日	2022年 3月28日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-	
301072	中捷精工	2021年 9月22日	2022年 3月29日	新股流 通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
301073	君亭酒店	2021年 9月22日	2022年 3月30日	新股流 通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301078	孩子王	2021年 9月30日	2022年 4月14日	新股流 通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301079	邵阳液压	2021年 10月11日	2022年 4月19日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-	
301081	严牌股份	2021年 10月13日	2022年 4月20日	新股流 通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301083	百胜智能	2021年 10月13日	2022年 4月21日	新股流 通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-	
301088	戎美股份	2021年 10月19日	2022年 4月28日	新股流 通受限	33.16	24.67	172	5,703.52	4,243.24	-	
301089	拓新药业	2021年 10月20日	2022年 4月27日	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301090	华润材料	2021年 10月19日	2022年 4月26日	新股流 通受限	10.45	11.22	981	10,251.45	11,006.82	-	
301091	深城交	2021年 10月20日	2022年 4月29日	新股流 通受限	36.50	31.31	262	9,563.00	8,203.22	-	
301092	争光股份	2021年 10月21日	2022年 5月5日	新股流 通受限	36.31	35.52	150	5,446.50	5,328.00	-	
301093	华兰	2021年	2022年	新股流	58.08	49.85	135	7,840.80	6,729.75	-	

	股份	10月21日	5月5日	通受限						
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	1,010	10,170.70	16,927.60	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	173	7,610.27	8,783.21	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	新股流通受限	21.96	93.40	2,469	54,219.24	230,604.60	-
688103	国力股份	2021年9月2日	2022年3月10日	新股流通受限	12.04	66.10	1,595	19,203.80	105,429.50	-
688280	精进电动	2021年10月19日	2022年4月27日	新股流通受限	13.78	13.63	6,416	88,412.48	87,450.08	-

注：1、截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10% 的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	9,607,496.09	-	-	-	9,607,496.09
结算备付金	4,531,187.05	-	-	-	4,531,187.05

存出保证金	1,685,846.53	-	-	-	1,685,846.53
交易性金融资产	-	-	-	-209,181,142.46	209,181,142.46
应收利息	-	-	-	3,309.99	3,309.99
应收证券清算款	-	-	-	2,290,804.72	2,290,804.72
资产总计	15,824,529.67	-	-	-211,475,257.17	227,299,786.84
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	97,120.37	97,120.37
应付托管费	-	-	-	19,424.09	19,424.09
应付证券清算款	-	-	-	2,604,922.25	2,604,922.25
应付交易费用	-	-	-	94,916.51	94,916.51
应交税费	-	-	-	7,700.14	7,700.14
其他负债	-	-	-	238,217.07	238,217.07
负债总计	-	-	-	3,062,300.43	3,062,300.43
利率敏感度缺口	15,824,529.67	-	-	-208,412,956.74	224,237,486.41
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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	209,181,142.46	93.29	334,392,157.85	99.28
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	209,181,142.46	93.29	334,392,157.85	99.28

7.4.13.4.2.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	10,874,154.96	16,728,065.88

	业绩比较基准下降 5%	-10,874,154.96	-16,728,065.88
--	----------------	----------------	----------------

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

本基金非以公允价值计量的金融工具，公允价值与账面价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 208,371,997.20 元，属于第二层次的余额为人民币 5,504.49 元，属于第三层次的余额为人民币 803,640.77 元(2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 329,640,979.09 元，属于第二层次的余额为人民币 148,082.01 元，属于第三层次的余额为人民币 4,603,096.75 元)。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 803,640.77 元；本报告期购买的属于第三层次的金额为人民币 331,036.30 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 472,604.47 元；本报告期转出第三层次的金额为人民币 3,989,109.98 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币-613,986.77 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 25 日经本基金管理人批准报出。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	209,181,142.46	92.03
	其中：股票	209,181,142.46	92.03
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	14,138,683.14	6.22
8	其他各项资产	3,979,961.24	1.75
9	合计	227,299,786.84	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,160,837.66	0.96
B	采矿业	5,678,548.75	2.53
C	制造业	123,352,375.62	55.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,511,096.37	2.46
E	建筑业	3,372,354.20	1.50
F	批发和零售业	2,649,975.05	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	5,358,317.75	2.39
H	住宿和餐饮业	447,352.40	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,025,338.04	3.58
J	金融业	37,141,926.48	16.56
K	房地产业	3,471,585.47	1.55
L	租赁和商务服务业	2,554,143.17	1.14
M	科学研究和技术服务业	2,333,702.83	1.04

N	水利、环境和公共设施管理业	446,124.95	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,585,219.38	0.71
R	文化、体育和娱乐业	755,221.56	0.34
S	综合	152,958.00	0.07
	合计	204,997,077.68	91.42

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	322,517.24	0.14
C	制造业	2,258,405.60	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	233,629.00	0.10
E	建筑业	11,519.99	0.01
F	批发和零售业	415,016.14	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	468,774.10	0.21
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,210.60	0.06
J	金融业	255,298.63	0.11
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	57,834.04	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	9,359.52	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	16,891.92	0.01
S	综合	-	-
	合计	4,184,064.78	1.87

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,355	10,977,750.00	4.90
2	300750	宁德时代	9,833	5,781,804.00	2.58
3	600036	招商银行	88,015	4,287,210.65	1.91
4	000858	五粮液	16,163	3,598,853.58	1.60
5	600900	长江电力	103,598	2,351,674.60	1.05
6	601318	中国平安	46,299	2,333,932.59	1.04
7	002594	比亚迪	7,488	2,007,682.56	0.90
8	601012	隆基股份	23,035	1,985,617.00	0.89
9	300760	迈瑞医疗	5,075	1,932,560.00	0.86
10	601888	中国中免	8,333	1,828,343.53	0.82
11	601166	兴业银行	88,658	1,688,048.32	0.75
12	600809	山西汾酒	5,195	1,640,477.10	0.73
13	300059	东方财富	43,002	1,595,804.22	0.71
14	603288	海天味业	14,939	1,570,238.29	0.70
15	000568	泸州老窖	5,869	1,489,963.03	0.66
16	002475	立讯精密	29,509	1,451,842.80	0.65
17	002352	顺丰控股	20,401	1,406,036.92	0.63
18	600276	恒瑞医药	27,188	1,378,703.48	0.61
19	600309	万华化学	13,383	1,351,683.00	0.60
20	000001	平安银行	80,908	1,333,363.84	0.59
21	603259	药明康德	10,842	1,285,644.36	0.57
22	601398	工商银行	268,768	1,244,395.84	0.55
23	601328	交通银行	261,130	1,203,809.30	0.54
24	600030	中信证券	45,484	1,201,232.44	0.54
25	002714	牧原股份	21,771	1,161,700.56	0.52
26	600887	伊利股份	25,994	1,077,711.24	0.48
27	600436	片仔癀	2,456	1,073,640.40	0.48
28	600000	浦发银行	125,387	1,069,551.11	0.48
29	603501	韦尔股份	3,357	1,043,254.89	0.47
30	600104	上汽集团	50,535	1,042,537.05	0.46
31	601919	中远海控	54,071	1,010,586.99	0.45
32	600600	青岛啤酒	10,197	1,009,503.00	0.45
33	002304	洋河股份	6,102	1,005,182.46	0.45
34	600016	民生银行	251,423	980,549.70	0.44
35	002142	宁波银行	25,066	959,526.48	0.43
36	601985	中国核电	114,750	952,425.00	0.42
37	300015	爱尔眼科	22,402	947,156.56	0.42

38	600406	国电南瑞	23,622	945,588.66	0.42
39	601288	农业银行	318,275	935,728.50	0.42
40	600690	海尔智家	31,238	933,703.82	0.42
41	300014	亿纬锂能	7,882	931,494.76	0.42
42	601688	华泰证券	51,795	919,879.20	0.41
43	600089	特变电工	43,162	913,739.54	0.41
44	002812	恩捷股份	3,646	912,958.40	0.41
45	600837	海通证券	73,976	906,945.76	0.40
46	601668	中国建筑	179,183	895,915.00	0.40
47	601211	国泰君安	48,908	874,964.12	0.39
48	300433	蓝思科技	37,998	873,194.04	0.39
49	600585	海螺水泥	21,534	867,820.20	0.39
50	601766	中国中车	141,900	864,171.00	0.39
51	600438	通威股份	19,105	858,960.80	0.38
52	601899	紫金矿业	87,887	852,503.90	0.38
53	300274	阳光电源	5,826	849,430.80	0.38
54	601816	京沪高铁	174,846	844,506.18	0.38
55	600019	宝钢股份	116,966	837,476.56	0.37
56	600031	三一重工	36,244	826,363.20	0.37
57	300122	智飞生物	6,514	811,644.40	0.36
58	601360	三六零	63,064	802,174.08	0.36
59	000002	万科A	40,498	800,240.48	0.36
60	603589	口子窖	11,289	800,051.43	0.36
61	600048	保利发展	51,028	797,567.64	0.36
62	601601	中国太保	29,267	793,721.04	0.35
63	000725	京东方A	156,370	789,668.50	0.35
64	601818	光大银行	235,131	780,634.92	0.35
65	002493	荣盛石化	42,072	764,027.52	0.34
66	002241	歌尔股份	14,106	763,134.60	0.34
67	300124	汇川技术	10,789	740,125.40	0.33
68	600028	中国石化	174,914	739,886.22	0.33
69	600893	航发动力	11,308	717,605.68	0.32
70	600111	北方稀土	15,464	708,251.20	0.32
71	002371	北方华创	2,019	700,633.38	0.31
72	600745	闻泰科技	5,305	685,936.50	0.31
73	002460	赣锋锂业	4,781	682,965.85	0.30
74	601390	中国中铁	117,087	677,933.73	0.30
75	600050	中国联通	171,000	672,030.00	0.30
76	601600	中国铝业	108,249	659,236.41	0.29
77	600150	中国船舶	25,838	640,524.02	0.29
78	601169	北京银行	143,066	635,213.04	0.28
79	601088	中国神华	28,167	634,320.84	0.28

80	600584	长电科技	20,000	620,400.00	0.28
81	600872	中炬高新	16,289	618,493.33	0.28
82	000776	广发证券	24,673	606,709.07	0.27
83	002459	晶澳科技	6,444	597,358.80	0.27
84	600919	江苏银行	101,664	592,701.12	0.26
85	601658	邮储银行	113,589	579,303.90	0.26
86	600346	恒力石化	25,037	575,099.89	0.26
87	603799	华友钴业	5,193	572,839.83	0.26
88	603019	中科曙光	20,500	565,185.00	0.25
89	002129	中环股份	13,508	563,959.00	0.25
90	000538	云南白药	5,356	560,505.40	0.25
91	600999	招商证券	31,618	558,057.70	0.25
92	688111	金山办公	2,100	556,500.00	0.25
93	600741	华域汽车	19,612	555,019.60	0.25
94	601615	明阳智能	20,980	547,578.00	0.24
95	600010	宝钢股份	194,764	543,391.56	0.24
96	000063	中兴通讯	16,166	541,561.00	0.24
97	600383	金地集团	41,455	537,671.35	0.24
98	601066	中信建投	18,320	535,860.00	0.24
99	002049	紫光国微	2,377	534,825.00	0.24
100	603806	福斯特	4,087	533,557.85	0.24
101	601669	中国电建	65,348	528,011.84	0.24
102	300896	爱美客	957	513,057.27	0.23
103	002311	海大集团	6,951	509,508.30	0.23
104	300498	温氏股份	26,382	508,117.32	0.23
105	002230	科大讯飞	9,673	507,929.23	0.23
106	000338	潍柴动力	28,295	506,197.55	0.23
107	601225	陕西煤业	41,369	504,701.80	0.23
108	600588	用友网络	14,019	503,001.72	0.22
109	002027	分众传媒	61,201	501,236.19	0.22
110	601877	正泰电器	9,207	496,165.23	0.22
111	000661	长春高新	1,790	485,806.00	0.22
112	300782	卓胜微	1,475	482,030.00	0.21
113	000166	申万宏源	93,748	479,989.76	0.21
114	603986	兆易创新	2,724	479,015.40	0.21
115	600183	生益科技	20,252	476,934.60	0.21
116	600219	南山铝业	100,631	473,972.01	0.21
117	688036	传音控股	3,000	470,700.00	0.21
118	603659	璞泰来	2,908	467,053.88	0.21
119	002821	凯莱英	1,073	466,755.00	0.21
120	601633	长城汽车	9,602	466,081.08	0.21
121	600332	白云山	13,460	460,332.00	0.21

122	601988	中国银行	150,024	457,573.20	0.20
123	601100	恒立液压	5,572	455,789.60	0.20
124	601727	上海电气	93,638	455,080.68	0.20
125	600989	宝丰能源	26,122	453,477.92	0.20
126	601857	中国石油	92,163	452,520.33	0.20
127	002709	天赐材料	3,926	450,115.90	0.20
128	600754	锦江酒店	7,634	447,352.40	0.20
129	600875	东方电气	20,797	445,471.74	0.20
130	300413	芒果超媒	7,772	444,713.84	0.20
131	000596	古井贡酒	1,807	440,908.00	0.20
132	001979	招商蛇口	33,034	440,673.56	0.20
133	601229	上海银行	60,617	432,199.21	0.19
134	688012	中微公司	3,400	430,440.00	0.19
135	600352	浙江龙盛	33,527	423,446.01	0.19
136	600196	复星医药	8,592	420,492.48	0.19
137	603993	洛阳钼业	75,313	420,246.54	0.19
138	600015	华夏银行	73,231	410,093.60	0.18
139	600660	福耀玻璃	8,557	403,376.98	0.18
140	000625	长安汽车	26,290	399,345.10	0.18
141	603392	万泰生物	1,789	396,263.50	0.18
142	600079	人福医药	17,552	395,271.04	0.18
143	603866	桃李面包	13,773	391,153.20	0.17
144	300088	长信科技	28,873	383,433.44	0.17
145	601009	南京银行	42,648	382,126.08	0.17
146	000895	双汇发展	11,966	377,527.30	0.17
147	601607	上海医药	18,999	377,510.13	0.17
148	002050	三花智控	14,881	376,489.30	0.17
149	600958	东方证券	25,483	375,619.42	0.17
150	300316	晶盛机电	5,384	374,188.00	0.17
151	600570	恒生电子	6,016	373,894.40	0.17
152	600161	天坛生物	12,837	371,759.52	0.17
153	601138	工业富联	31,011	369,651.12	0.16
154	300759	康龙化成	2,600	367,302.00	0.16
155	300999	金龙鱼	5,793	364,553.49	0.16
156	000100	TCL 科技	58,340	359,957.80	0.16
157	300142	沃森生物	6,318	355,071.60	0.16
158	601628	中国人寿	11,777	354,369.93	0.16
159	601865	福莱特	6,100	353,434.00	0.16
160	603939	益丰药房	6,366	350,830.26	0.16
161	300454	深信服	1,830	349,530.00	0.16
162	601336	新华保险	8,921	346,848.48	0.15
163	600886	国投电力	29,808	341,897.76	0.15

164	300408	三环集团	7,509	334,901.40	0.15
165	603833	欧派家居	2,245	331,137.50	0.15
166	600711	盛屯矿业	30,800	330,484.00	0.15
167	002001	新和成	10,601	329,903.12	0.15
168	600038	中直股份	4,072	326,981.60	0.15
169	600926	杭州银行	25,322	324,628.04	0.14
170	600132	重庆啤酒	2,140	323,824.80	0.14
171	601555	东吴证券	36,537	323,717.82	0.14
172	300661	圣邦股份	1,038	320,742.00	0.14
173	603486	科沃斯	2,109	318,353.55	0.14
174	601216	君正集团	60,022	313,915.06	0.14
175	601117	中国化学	26,075	312,900.00	0.14
176	601233	桐昆股份	14,713	311,621.34	0.14
177	600176	中国巨石	17,101	311,238.20	0.14
178	600029	南方航空	45,098	307,117.38	0.14
179	000799	酒鬼酒	1,437	305,362.50	0.14
180	002736	国信证券	26,536	304,633.28	0.14
181	600460	士兰微	5,602	303,628.40	0.14
182	600011	华能国际	31,219	302,512.11	0.13
183	600061	国投资本	36,702	301,690.44	0.13
184	300207	欣旺达	7,143	301,148.88	0.13
185	300628	亿联网络	3,674	299,247.30	0.13
186	300033	同花顺	2,057	297,401.06	0.13
187	002013	中航机电	16,178	294,116.04	0.13
188	300751	迈为股份	456	292,888.80	0.13
189	002236	大华股份	12,446	292,232.08	0.13
190	601618	中国中冶	76,239	291,995.37	0.13
191	300296	利亚德	28,485	291,971.25	0.13
192	000963	华东医药	7,239	291,007.80	0.13
193	603369	今世缘	5,347	290,876.80	0.13
194	600362	江西铜业	12,983	289,910.39	0.13
195	000723	美锦能源	17,846	289,640.58	0.13
196	600547	山东黄金	15,382	289,489.24	0.13
197	600845	宝信软件	4,734	287,969.22	0.13
198	603290	斯达半导	754	287,274.00	0.13
199	002920	德赛西威	2,027	286,840.77	0.13
200	000733	振华科技	2,300	285,844.00	0.13
201	600426	华鲁恒升	9,050	283,265.00	0.13
202	002648	卫星化学	7,076	283,252.28	0.13
203	000876	新希望	18,621	283,225.41	0.13
204	601377	兴业证券	28,611	282,676.68	0.13
205	601155	新城控股	9,696	282,444.48	0.13

206	600763	通策医疗	1,418	282,182.00	0.13
207	601916	浙商银行	80,079	280,276.50	0.12
208	688008	澜起科技	3,334	279,622.58	0.12
209	300223	北京君正	2,074	277,916.00	0.12
210	002601	龙佰集团	9,718	277,837.62	0.12
211	603816	顾家家居	3,594	277,313.04	0.12
212	601016	节能风电	42,300	275,373.00	0.12
213	601699	潞安环能	24,309	274,934.79	0.12
214	002074	国轩高科	5,362	274,802.50	0.12
215	600160	巨化股份	21,091	272,284.81	0.12
216	300601	康泰生物	2,754	271,379.16	0.12
217	000938	紫光股份	11,846	270,681.10	0.12
218	603077	和邦生物	79,200	270,072.00	0.12
219	002938	鹏鼎控股	6,289	266,842.27	0.12
220	002756	永兴材料	1,800	266,436.00	0.12
221	000301	东方盛虹	13,756	266,041.04	0.12
222	002916	深南电路	2,164	263,618.48	0.12
223	601881	中国银河	23,280	260,503.20	0.12
224	002602	世纪华通	30,953	259,695.67	0.12
225	300496	中科创达	1,875	259,537.50	0.12
226	601162	天风证券	64,039	259,357.95	0.12
227	600779	水井坊	2,159	259,058.41	0.12
228	601111	中国国航	28,366	258,981.58	0.12
229	002791	坚朗五金	1,422	258,220.98	0.12
230	601799	星宇股份	1,263	257,967.75	0.12
231	600027	华电国际	47,624	254,788.40	0.11
232	300763	锦浪科技	1,100	254,705.00	0.11
233	603899	晨光文具	3,919	252,814.69	0.11
234	002555	三七互娱	9,307	251,475.14	0.11
235	603260	合盛硅业	1,900	250,743.00	0.11
236	000786	北新建材	6,971	249,770.93	0.11
237	600380	健康元	19,438	249,583.92	0.11
238	600998	九州通	16,938	249,327.36	0.11
239	600153	建发股份	27,451	248,980.57	0.11
240	601788	光大证券	16,674	248,942.82	0.11
241	601689	拓普集团	4,673	247,669.00	0.11
242	688006	杭可科技	2,300	247,434.00	0.11
243	600109	国金证券	21,825	247,277.25	0.11
244	600918	中泰证券	24,778	247,036.66	0.11
245	002120	韵达股份	12,035	246,236.10	0.11
246	601901	方正证券	31,400	246,176.00	0.11
247	600188	兖矿能源	10,454	245,982.62	0.11

248	603658	安图生物	4,462	245,677.72	0.11
249	600039	四川路桥	20,316	244,604.64	0.11
250	688169	石头科技	300	243,900.00	0.11
251	601939	建设银行	40,920	239,791.20	0.11
252	000069	华侨城 A	33,966	239,120.64	0.11
253	002414	高德红外	9,827	237,911.67	0.11
254	002080	中材科技	6,945	236,268.90	0.11
255	600795	国电电力	74,200	235,214.00	0.10
256	002202	金风科技	14,262	234,895.14	0.10
257	300450	先导智能	3,157	234,786.09	0.10
258	600563	法拉电子	1,000	232,400.00	0.10
259	600606	绿地控股	53,473	232,072.82	0.10
260	603737	三棵树	1,665	231,684.75	0.10
261	600487	亨通光电	15,300	231,336.00	0.10
262	600885	宏发股份	3,093	230,861.52	0.10
263	300418	昆仑万维	9,957	230,504.55	0.10
264	603858	步长制药	10,839	228,594.51	0.10
265	603882	金城医学	2,046	227,863.02	0.10
266	601866	中远海发	70,100	227,825.00	0.10
267	601077	渝农商行	58,965	227,015.25	0.10
268	600705	中航产融	57,004	226,305.88	0.10
269	600233	圆通速递	13,372	223,044.96	0.10
270	601995	中金公司	4,540	222,596.20	0.10
271	600522	中天科技	13,091	222,023.36	0.10
272	002007	华兰生物	7,550	220,007.00	0.10
273	601878	浙商证券	16,562	218,287.16	0.10
274	603160	汇顶科技	2,023	218,018.71	0.10
275	002465	海格通信	19,963	217,995.96	0.10
276	603707	健友股份	5,181	217,602.00	0.10
277	600018	上港集团	39,673	217,408.04	0.10
278	002600	领益智造	29,539	217,407.04	0.10
279	688126	沪硅产业	8,400	216,888.00	0.10
280	002625	光启技术	9,027	216,738.27	0.10
281	600511	国药股份	6,841	215,696.73	0.10
282	002841	视源股份	2,648	215,547.20	0.10
283	601966	玲珑轮胎	5,873	214,658.15	0.10
284	600315	上海家化	5,308	214,496.28	0.10
285	002180	纳思达	4,460	213,009.60	0.09
286	000157	中联重科	29,664	212,690.88	0.09
287	300347	泰格医药	1,657	211,764.60	0.09
288	600298	安琪酵母	3,483	210,233.88	0.09
289	000977	浪潮信息	5,808	208,100.64	0.09

290	688180	君实生物	3,100	207,638.00	0.09
291	002340	格林美	19,851	205,457.85	0.09
292	300037	新宙邦	1,816	205,208.00	0.09
293	688002	睿创微纳	2,600	204,282.00	0.09
294	603185	上机数控	1,217	203,214.66	0.09
295	002240	盛新锂能	3,500	202,825.00	0.09
296	603456	九洲药业	3,600	202,536.00	0.09
297	600115	中国东航	38,878	200,610.48	0.09
298	002064	华峰化学	19,188	200,322.72	0.09
299	300595	欧普康视	3,486	199,991.82	0.09
300	300699	光威复材	2,341	197,767.68	0.09
301	000425	徐工机械	32,638	195,501.62	0.09
302	600674	川投能源	15,635	195,437.50	0.09
303	601636	旗滨集团	11,398	194,905.80	0.09
304	688122	西部超导	2,000	193,880.00	0.09
305	603568	伟明环保	5,300	193,609.00	0.09
306	601058	赛轮轮胎	13,046	192,950.34	0.09
307	002252	上海莱士	28,106	191,682.92	0.09
308	002384	东山精密	7,061	191,353.10	0.09
309	688009	中国通号	38,412	191,291.76	0.09
310	002268	卫士通	3,400	190,196.00	0.08
311	600009	上海机场	4,060	189,561.40	0.08
312	300146	汤臣倍健	7,018	189,205.28	0.08
313	600170	上海建工	52,478	188,920.80	0.08
314	600256	广汇能源	28,864	188,770.56	0.08
315	002568	百润股份	3,133	187,447.39	0.08
316	600803	新奥股份	10,200	187,272.00	0.08
317	300390	天华超净	2,300	186,300.00	0.08
318	603605	珀莱雅	889	185,187.59	0.08
319	603345	安井食品	1,081	184,613.18	0.08
320	603267	鸿远电子	1,028	184,464.32	0.08
321	601838	成都银行	15,372	184,464.00	0.08
322	002326	永太科技	3,600	184,356.00	0.08
323	603883	老百姓	3,691	182,261.58	0.08
324	002385	大北农	17,312	181,602.88	0.08
325	002558	巨人网络	15,093	180,663.21	0.08
326	603198	迎驾贡酒	2,600	180,570.00	0.08
327	300726	宏达电子	1,800	180,108.00	0.08
328	600486	扬农化工	1,370	179,744.00	0.08
329	601577	长沙银行	22,800	178,068.00	0.08
330	300724	捷佳伟创	1,537	175,679.10	0.08
331	600516	方大炭素	16,229	175,597.78	0.08

332	600141	兴发集团	4,600	174,248.00	0.08
333	300073	当升科技	2,000	173,740.00	0.08
334	000783	长江证券	22,952	173,058.08	0.08
335	000066	中国长城	12,193	172,652.88	0.08
336	000739	普洛药业	4,911	172,326.99	0.08
337	603338	浙江鼎力	2,147	172,318.22	0.08
338	300529	健帆生物	3,232	172,265.60	0.08
339	002185	华天科技	13,394	170,237.74	0.08
340	300003	乐普医疗	7,515	170,064.45	0.08
341	603517	绝味食品	2,488	170,005.04	0.08
342	601108	财通证券	15,247	169,546.64	0.08
343	002151	北斗星通	4,297	168,657.25	0.08
344	000738	航发控制	5,511	166,873.08	0.07
345	000825	太钢不锈	23,687	166,756.48	0.07
346	002409	雅克科技	2,047	166,154.99	0.07
347	601231	环旭电子	10,217	164,085.02	0.07
348	002624	完美世界	8,078	164,064.18	0.07
349	603613	国联股份	1,521	163,507.50	0.07
350	603127	昭衍新药	1,409	162,640.87	0.07
351	000703	恒逸石化	15,211	161,540.82	0.07
352	300676	华大基因	1,830	160,674.00	0.07
353	601198	东兴证券	13,793	160,412.59	0.07
354	002850	科达利	1,000	160,340.00	0.07
355	002024	苏宁易购	38,666	159,303.92	0.07
356	688208	道通科技	2,000	158,800.00	0.07
357	002266	浙富控股	22,244	158,377.28	0.07
358	002353	杰瑞股份	3,935	157,400.00	0.07
359	000519	中兵红箭	5,900	157,353.00	0.07
360	002532	天山铝业	19,300	157,295.00	0.07
361	002372	伟星新材	6,440	156,620.80	0.07
362	601933	永辉超市	38,627	156,439.35	0.07
363	300251	光线传媒	12,172	156,410.20	0.07
364	000831	五矿稀土	4,000	156,080.00	0.07
365	002223	鱼跃医疗	4,123	155,849.40	0.07
366	601990	南京证券	15,700	155,587.00	0.07
367	688188	柏楚电子	400	154,184.00	0.07
368	300144	宋城演艺	10,761	154,097.52	0.07
369	600177	雅戈尔	22,248	153,288.72	0.07
370	000009	中国宝安	10,600	152,958.00	0.07
371	000630	铜陵有色	43,845	152,580.60	0.07
372	002028	思源电气	3,100	152,551.00	0.07
373	002405	四维图新	9,532	151,749.44	0.07

374	601992	金隅集团	53,376	151,587.84	0.07
375	300253	卫宁健康	8,969	150,320.44	0.07
376	688185	康希诺	500	149,775.00	0.07
377	600392	盛和资源	7,600	149,112.00	0.07
378	002673	西部证券	18,463	148,996.41	0.07
379	000932	华菱钢铁	28,864	147,495.04	0.07
380	300558	贝达药业	1,835	146,488.05	0.07
381	688202	美迪西	300	145,677.00	0.06
382	002531	天顺风能	7,500	145,425.00	0.06
383	002444	巨星科技	4,756	145,105.56	0.06
384	000807	云铝股份	12,932	144,450.44	0.06
385	600655	豫园股份	13,928	143,458.40	0.06
386	002192	融捷股份	1,100	143,165.00	0.06
387	601319	中国人保	30,392	142,842.40	0.06
388	603233	大参林	3,389	142,710.79	0.06
389	603712	七一二	3,278	141,937.40	0.06
390	000983	山西焦煤	17,114	141,532.78	0.06
391	000155	川能动力	5,300	140,609.00	0.06
392	002508	老板电器	3,896	140,333.92	0.06
393	300383	光环新网	9,450	140,238.00	0.06
394	000591	太阳能	12,500	140,000.00	0.06
395	002407	多氟多	3,100	139,469.00	0.06
396	600338	西藏珠峰	3,700	139,342.00	0.06
397	601598	中国外运	31,073	139,207.04	0.06
398	000629	攀钢钒钛	35,781	139,188.09	0.06
399	000728	国元证券	17,995	138,561.50	0.06
400	600549	厦门钨业	6,114	138,359.82	0.06
401	002939	长城证券	10,635	137,723.25	0.06
402	300308	中际旭创	3,238	137,615.00	0.06
403	002557	洽洽食品	2,242	137,569.12	0.06
404	002497	雅化集团	4,800	137,568.00	0.06
405	600143	金发科技	10,880	136,870.40	0.06
406	000999	华润三九	3,993	136,720.32	0.06
407	002507	涪陵榨菜	3,590	135,702.00	0.06
408	000709	河钢股份	54,918	135,098.28	0.06
409	002603	以岭药业	6,884	134,926.40	0.06
410	000960	锡业股份	6,900	134,757.00	0.06
411	603218	日月股份	4,078	134,370.10	0.06
412	600521	华海药业	6,196	134,205.36	0.06
413	603444	吉比特	318	134,148.30	0.06
414	000027	深圳能源	16,530	133,893.00	0.06
415	000800	一汽解放	12,909	132,833.61	0.06

416	600704	物产中大	22,373	132,448.16	0.06
417	002456	欧菲光	13,645	132,356.50	0.06
418	002032	苏泊尔	2,117	131,762.08	0.06
419	002463	沪电股份	7,886	130,749.88	0.06
420	000050	深天马 A	10,039	130,707.78	0.06
421	002797	第一创业	17,582	128,700.24	0.06
422	600699	均胜电子	5,849	128,502.53	0.06
423	000998	隆平高科	5,523	128,464.98	0.06
424	002044	美年健康	16,308	128,017.80	0.06
425	300725	药石科技	900	127,953.00	0.06
426	002078	太阳纸业	11,059	127,067.91	0.06
427	002157	正邦科技	13,121	126,748.86	0.06
428	002294	信立泰	4,629	126,464.28	0.06
429	000423	东阿阿胶	2,592	126,360.00	0.06
430	002299	圣农发展	5,202	125,732.34	0.06
431	300850	新强联	700	124,957.00	0.06
432	002138	顺络电子	3,265	124,657.70	0.06
433	300677	英科医疗	2,129	123,141.36	0.05
434	002408	齐翔腾达	11,600	121,800.00	0.05
435	002152	广电运通	10,197	121,344.30	0.05
436	000830	鲁西化工	7,920	120,859.20	0.05
437	002430	杭氧股份	4,014	120,460.14	0.05
438	600801	华新水泥	6,218	120,007.40	0.05
439	600498	烽火通信	6,673	119,980.54	0.05
440	002030	达安基因	5,931	118,975.86	0.05
441	601456	国联证券	8,473	118,367.81	0.05
442	002153	石基信息	4,107	118,035.18	0.05
443	000988	华工科技	4,139	115,312.54	0.05
444	300832	新产业	2,600	114,530.00	0.05
445	600583	海油工程	24,809	114,369.49	0.05
446	300568	星源材质	3,100	113,863.00	0.05
447	600415	小商品城	23,375	113,368.75	0.05
448	300357	我武生物	1,973	113,052.90	0.05
449	000987	越秀金控	12,849	111,786.30	0.05
450	002010	传化智联	12,781	111,194.70	0.05
451	603638	艾迪精密	3,479	111,049.68	0.05
452	000683	远兴能源	15,200	110,960.00	0.05
453	600598	北大荒	7,560	110,073.60	0.05
454	000547	航天发展	6,544	109,284.80	0.05
455	002422	科伦药业	5,752	108,885.36	0.05
456	600688	上海石化	26,106	108,862.02	0.05
457	002156	通富微电	5,577	108,361.11	0.05

458	002145	中核钛白	8,600	108,274.00	0.05
459	002541	鸿路钢构	2,000	107,080.00	0.05
460	002925	盈趣科技	3,146	107,058.38	0.05
461	002926	华西证券	10,807	106,448.95	0.05
462	601696	中银证券	7,900	106,255.00	0.05
463	600988	赤峰黄金	7,082	105,521.80	0.05
464	000860	顺鑫农业	2,686	102,551.48	0.05
465	002429	兆驰股份	20,969	101,909.34	0.05
466	002065	东华软件	12,976	101,212.80	0.05
467	002092	中泰化学	10,600	101,124.00	0.05
468	000975	银泰黄金	11,478	100,776.84	0.04
469	002690	美亚光电	2,689	100,729.94	0.04
470	000021	深科技	6,297	99,744.48	0.04
471	300136	信维通信	3,930	99,507.60	0.04
472	600848	上海临港	6,670	99,182.90	0.04
473	000656	金科股份	22,111	99,057.28	0.04
474	000513	丽珠集团	2,452	98,594.92	0.04
475	002500	山西证券	14,873	98,161.80	0.04
476	600895	张江高科	6,484	97,649.04	0.04
477	002373	千方科技	6,411	95,844.45	0.04
478	002212	天融信	4,944	94,776.48	0.04
479	300070	碧水源	13,093	94,138.67	0.04
480	300212	易华录	2,645	93,500.75	0.04
481	300773	拉卡拉	3,207	93,067.14	0.04
482	000750	国海证券	22,574	92,779.14	0.04
483	002506	协鑫集成	24,390	92,682.00	0.04
484	002511	中顺洁柔	5,501	91,921.71	0.04
485	002958	青农商行	23,065	89,030.90	0.04
486	300432	富临精工	3,000	88,200.00	0.04
487	600026	中远海能	14,729	87,195.68	0.04
488	000686	东北证券	9,893	86,860.54	0.04
489	002563	森马服饰	11,113	85,903.49	0.04
490	002146	荣盛发展	17,926	77,978.10	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	19,006	713,865.36	0.32
2	600489	中金黄金	39,188	322,517.24	0.14
3	601872	招商轮船	60,957	249,923.70	0.11
4	600867	通化东宝	22,478	246,358.88	0.11

5	600642	申能股份	31,700	233,629.00	0.10
6	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.10
7	601021	春秋航空	3,853	218,850.40	0.10
8	600739	辽宁成大	10,327	201,583.04	0.09
9	600066	宇通客车	15,715	173,179.30	0.08
10	600909	华安证券	29,523	159,719.43	0.07
11	688359	三孚新科	2,213	129,814.58	0.06
12	688319	欧林生物	3,412	122,183.72	0.05
13	600859	王府井	4,103	110,781.00	0.05
14	600536	中国软件	2,187	109,196.91	0.05
15	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.05
16	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.04
17	601099	太平洋	29,140	95,579.20	0.04
18	600827	百联股份	6,694	89,231.02	0.04
19	688280	精进电动	6,416	87,450.08	0.04
20	000401	冀东水泥	5,788	69,224.48	0.03
21	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
22	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
23	301149	隆华新材	1,010	16,927.60	0.01
24	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
25	301039	中集车辆	1,153	14,424.03	0.01
26	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
27	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
28	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
29	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
30	301013	利和兴	471	12,104.70	0.01
31	301090	华润材料	981	11,006.82	0.00
32	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
33	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
34	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
35	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
36	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
37	301179	泽宇智能	173	8,783.21	0.00
38	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
39	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
40	301091	深城交	262	8,203.22	0.00
41	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
42	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
43	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
44	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
45	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
46	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
47	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00

48	301093	华兰股份	135	6,729.75	0.00
49	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
50	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
51	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
52	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
53	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
54	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
55	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
56	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
57	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
58	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
59	301092	争光股份	150	5,328.00	0.00
60	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
61	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
62	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
63	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
64	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
65	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
66	301088	戎美股份	172	4,243.24	0.00
67	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
68	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
69	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	8,956,370.00	2.66
2	000858	五粮液	6,937,881.00	2.06
3	000333	美的集团	4,441,194.80	1.32
4	000001	平安银行	3,494,609.00	1.04
5	000568	泸州老窖	3,102,579.98	0.92
6	002594	比亚迪	3,095,917.00	0.92
7	002352	顺丰控股	3,001,969.00	0.89
8	300760	迈瑞医疗	2,904,249.00	0.86
9	002304	洋河股份	2,519,075.65	0.75
10	002714	牧原股份	2,452,080.69	0.73
11	002475	立讯精密	2,303,722.00	0.68
12	300059	东方财富	2,265,614.00	0.67
13	300122	智飞生物	2,208,317.00	0.66
14	300015	爱尔眼科	2,140,811.63	0.64
15	600276	恒瑞医药	1,947,268.20	0.58
16	000002	万科A	1,874,863.19	0.56

17	002142	宁波银行	1,770,146.60	0.53
18	300274	阳光电源	1,751,590.92	0.52
19	601012	隆基股份	1,680,638.00	0.50
20	300124	汇川技术	1,664,942.00	0.49

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	12,607,406.10	3.74
2	000858	五粮液	10,408,870.39	3.09
3	600519	贵州茅台	5,826,188.55	1.73
4	000001	平安银行	5,623,376.76	1.67
5	002594	比亚迪	4,671,784.17	1.39
6	000568	泸州老窖	4,270,567.31	1.27
7	002415	海康威视	3,970,778.32	1.18
8	300760	迈瑞医疗	3,894,007.49	1.16
9	000333	美的集团	3,596,208.21	1.07
10	002304	洋河股份	3,512,841.64	1.04
11	002352	顺丰控股	3,458,228.26	1.03
12	300059	东方财富	3,417,779.74	1.01
13	002714	牧原股份	3,407,974.31	1.01
14	002475	立讯精密	3,360,890.04	1.00
15	300015	爱尔眼科	3,150,155.97	0.94
16	300122	智飞生物	3,020,954.69	0.90
17	601012	隆基股份	2,910,246.04	0.86
18	300124	汇川技术	2,749,270.37	0.82
19	600276	恒瑞医药	2,731,079.37	0.81
20	000002	万科A	2,639,491.26	0.78

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	249,754,563.40
卖出股票收入（成交）总额	305,870,112.93

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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
IC2203	IC2203	4	5,844,640.00	175,080.00	-
IF2203	IF2203	3	4,455,540.00	61,680.00	-
公允价值变动总额合计（元）					236,760.00
股指期货投资本期收益（元）					382,893.20
股指期货投资本期公允价值变动（元）					167,220.00

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,685,846.53

2	应收证券清算款	2,290,804.72
3	应收股利	-
4	应收利息	3,309.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,979,961.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
1,746	81,217.40	90,174,559.00	63.59	51,631,023.00	36.41

9.1.2 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 (%)
其中：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	24,188,200.00	17.06

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	国开金融有限责任公	46,440,000.00	32.75

	司		
2	广发证券股份有限公司	3,868,699.00	2.73
3	招商证券股份有限公司	3,541,739.00	2.50
4	中航安盟财产保险有限公司—自有资金	3,164,900.00	2.23
5	张晓川	2,880,000.00	2.03
6	方正证券股份有限公司	2,862,100.00	2.02
7	中信建投证券股份有限公司	2,697,348.00	1.90
8	中信证券股份有限公司	2,443,622.00	1.72
9	陈燕	2,000,000.00	1.41
10	詹菊香	1,780,000.00	1.26
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	24,188,200.00	17.06

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和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。

§ 10 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	174,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	261,000,000.00
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	141,805,582.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 50,000.00 元。该审计机构连续三年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	265,447,198.61	48.73%	194,123.90	42.74%	-
中泰证券	4	173,304,205.80	31.82%	161,397.82	35.53%	-
兴业证券	1	105,959,308.17	19.45%	98,680.21	21.73%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	5	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增 1 个交

						易单 元
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	新增 1 个交 易单 元

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-1-20

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	2021-1-20
3	《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》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-29
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	2021-1-29
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	2021-1-29
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	2021-1-29
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	2021-1-29
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	2021-3-29
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	2021-3-29
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	2021-3-30
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	2021-3-30
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	2021-3-30
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	2021-3-30
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	2021-4-7
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	2021-4-21
16	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指	本基金管理人网站, 中	2021-4-21

	数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	国证监会基金电子披露网站	
17	《银华基金管理股份有限公司关于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更基金简称、扩位简称及申赎简称的公告》	本基金管理人网站, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-10
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	2021-5-10
19	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-7-19
20	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-19
21	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2021-8-28
22	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-28
23	《银华基金管理股份有限公司关于增加安信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, 上海证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-10-22
24	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-10-26
25	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-10-26
26	《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	2021-12-24
27	《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更新 (2021 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-24
28	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》	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	2021-12-31
29	《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	2021-12-31
30	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指	本基金管理人网站, 中	2021-12-31

数证券投资基金招募说明书更新 (2021 年第 4 号)》	国证监会基金电子披露 网站
----------------------------------	------------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20211231	46,440,000.00	-	-	46,440,000.00	32.75
	2	20210202-20210203	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210205-20210207	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210210-20210221	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210223-20210308	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210310-20210314	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210406-20210411	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210421-20210511	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210701-20210701	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210727-20210801	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210803-20210818	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210825-20210825	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210831-20210831	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210906-20210909	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
	2	20210913-20210915	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-

2	20210104-20210126	45,235,600.00	5,764,400.00	51,000,000.00	-	-
---	-------------------	---------------	--------------	---------------	---	---

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 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”。

4、本基金管理人于 2021 年 12 月 31 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2021 年 12 月 31 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 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

13.1.2 《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》

13.1.3 《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》

13.1.4 《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》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2022 年 3 月 29 日