

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证
券投资基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 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 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61

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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 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（扩位证券简称：沪港深 500ETF）
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	752,793,000.00 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

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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>

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(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-31,023,851.79
本期利润	-48,767,920.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0610
本期加权平均净值利润率	-7.74%
本期基金份额净值增长率	-6.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-139,613,697.46
期末可供分配基金份额利润	-0.1855
期末基金资产净值	613,179,302.54
期末基金份额净值	0.8145
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-18.55%

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

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

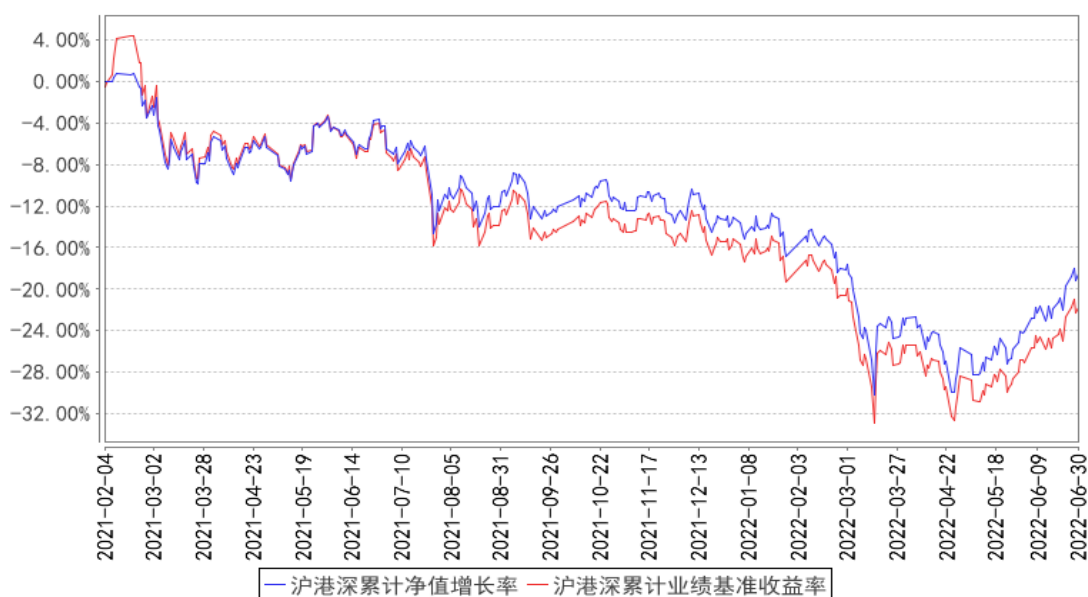
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.23%	1.09%	6.87%	1.13%	0.36%	-0.04%
过去三个月	6.46%	1.38%	5.93%	1.36%	0.53%	0.02%
过去六个月	-6.33%	1.50%	-7.78%	1.55%	1.45%	-0.05%
过去一年	-14.85%	1.28%	-17.88%	1.31%	3.03%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-18.55%	1.21%	-21.78%	1.28%	3.23%	-0.07%

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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例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资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 174 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 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、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰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发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业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		
李璇士 宜女	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	8 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

					<p>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 日至 2022 年 6 月 29 日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 日至 2022 年 6 月 29 日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 日至 2022 年 6 月 29 日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 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 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，自 2021 年 10 月 26 日起兼任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基金经理，自 2022 年 1 月 17 日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 7 日起兼任银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	9.5 年	<p>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</p>

					<p>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 日至 2022 年 6 月 20 日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 日至 2022 年 6 月 20 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 日至 2022 年 6 月 20 日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 日至 2022 年 6 月 20 日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，自 2021 年 10 月 26 日起兼任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基金经理，自 2021 年 12 月 7 日起兼任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基金经理，自 2021 年 12 月 30 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发起式联接基金基金经理，自 2022 年 1 月 4 日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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，自 2022 年 6 月 30 日起兼任银华中证全指电力公用事业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。</p>
谭普景生	本基金的基金经理助理	2021 年 4 月 19 日	-	8 年	<p>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</p>

					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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证沪港深 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。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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两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。

4.3.2 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不存在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。

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

2022 年上半年，新冠疫情在全球范围内由德尔塔时期转入奥密克戎时期。随着高传播性的新毒株从海外传入，以上海、北京为代表的多个国内城市与疫情进行了持续高强度作战。在整个上半年中，工业生产、餐饮服务、人员流动等社会活动都受到疫情的明显影响。海外方面，以俄乌冲突为核心的地缘争端从突发转入逐步相持，以原油为代表的资源品价格持续提升，在进入二季度后呈现高位震荡，这一过程向全球范围扩散了通胀压力。在上述因素作用下，A 股和港股市场

在上半年中整体呈现调整。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8145 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.33%，业绩比较基准收益率为-7.78%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，药物的研发与扩产进程、海外地缘冲突的演化程度等因素，仍将是市场表现的潜在影响因素。某一个限制因素的持续放松或解除，都会使相应行业的公司经营得到潜在的机遇。在这一背景下，A 股和港股市场仍将存在机会。

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

托管人声明：

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遵规守信、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,660,415.90	36,832,964.50
结算备付金		47,237.24	50,977.03
存出保证金		14,650.92	38,481.92
交易性金融资产	6.4.7.2	580,428,124.30	696,349,170.73
其中：股票投资		580,428,124.30	696,349,170.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	74,338.24
应收股利		1,605,894.95	50,156.14
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	5,830.78
资产总计		613,756,323.31	733,401,919.34
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31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		-	-
应付清算款		49.57	57.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		244,302.47	322,825.74
应付托管费		48,860.50	64,565.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	43.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	283,808.23	222,746.88
负债合计		577,020.77	610,238.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	752,793,000.00	842,793,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-139,613,697.46	-110,001,319.60
净资产合计		613,179,302.54	732,791,680.40
负债和净资产总计		613,756,323.31	733,401,919.34

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8145 元，基金份额总额 752,793,000.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 2 月 4 日(基金合同 生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-46,763,903.75	-66,360,722.47
1. 利息收入		60,716.19	392,144.36
其中：存款利息收入	6.4.7.13	60,716.19	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）		-29,237,554.89	-18,031,488.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-35,840,860.50	-27,766,426.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	14,210.52	-
股利收益	6.4.7.19	6,589,095.09	9,734,937.64
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-17,744,068.81	-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）	6.4.7.21	157,003.76	906,179.53
减：二、营业总支出		2,004,016.85	5,703,033.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,569,656.78	2,481,661.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	313,931.40	496,332.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		51.18	-

8. 其他费用	6.4.7.23	120,377.49	2,725,039.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,767,920.60	-72,063,756.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,767,920.60	-72,063,756.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,767,920.60	-72,063,756.11

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	842,793,000.00	-	-110,001,319.60	732,791,680.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	842,793,000.00	-	-110,001,319.60	732,791,680.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,000,000.00	-	-29,612,377.86	-119,612,377.86
(一)、综合收益总额	-	-	-48,767,920.60	-48,767,920.60
(二)、本期基金份额	-90,000,000.00	-	19,155,542.74	-70,844,457.26

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	-	-6,205,992.65	23,794,007.35
2. 基金赎回款	-120,000,000.00	-	25,361,535.39	-94,638,464.61
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	752,793,000.00	-	-139,613,697.46	613,179,302.54
项目	上年度可比期间			
	2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,482,793,000.00	-	-	1,482,793,000.00
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,482,793,000.00	-	-	1,482,793,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-420,000,000.00	-	-46,117,710.29	-466,117,710.29
(一)、综合收益总额	-	-	-72,063,756.11	-72,063,756.11
(二)、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
(三)、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)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(基金 净值)	1,062,793,000.00	-	-46,117,710.29	1,016,675,289.71

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》注册,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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述 6.4.4.1 至 6.4.4.4 中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及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。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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。

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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

以摊余成本计量的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。

6.4.5 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

“财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证

券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 36,832,964.50 元、50,977.03 元、38,481.92 元、5,830.78 元、74,338.24 元和 50,156.14 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 36,837,022.73 元、52,730.55 元、38,500.95 元、0.00 元、74,338.24 元和 50,156.14 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 696,349,170.73 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 696,349,170.73 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 57.67 元、322,825.74 元、64,565.13 元和 122,746.88 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 57.67 元、322,825.74 元、64,565.13 元、122,746.88 和 100,000.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披

露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。”

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	31,660,415.90
等于：本金	31,657,231.44
加：应计利息	3,184.46
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	31,660,415.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	715,195,253.55	-	580,428,124.30	-134,767,129.25
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	715,195,253.55	-	580,428,124.30	-134,767,129.25

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 债权投资

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	74,712.29
其中：交易所市场	74,712.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
合计	283,808.23

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	842,793,000.00	842,793,000.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-120,000,000.00	-120,000,000.00
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	752,793,000.00	752,793,000.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 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
本期期初	-33,868,216.60	-76,133,103.00	-110,001,319.60
本期利润	-31,023,851.79	-17,744,068.81	-48,767,920.60
本期基金份额交易产生的变动数	4,906,546.90	14,248,995.84	19,155,542.74
其中：基金申购款	-1,936,016.41	-4,269,976.24	-6,205,992.65
基金赎回款	6,842,563.31	18,518,972.08	25,361,535.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,985,521.49	-79,628,175.97	-139,613,697.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	58,412.74
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	1,993.84
其他	309.61
合计	60,716.19

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,087,369.07
股票投资收益——赎回差价收入	-5,753,491.43
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	-35,840,860.50

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	88,097,977.84
减：卖出股票成本总额	117,934,040.99

减：交易费用	251,305.92
买卖股票差价收入	-30,087,369.07

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	94,638,464.61
减：现金支付赎回款总额	61,612,195.61
减：赎回股票成本总额	38,779,760.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,753,491.43

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出权证成交总额	14,642.73
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	5.73
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	426.48
买卖权证差价收入	14,210.52

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日

股票投资产生的股利收益	6,589,095.09
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	6,589,095.09

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-17,744,068.81
股票投资	-17,744,068.81
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	-17,744,068.81

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	157,003.76
合计	157,003.76

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,757.63
其他	9,523.92
合计	120,377.49

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人
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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	1,569,656.78	2,481,661.51
其中：支付销售机构的客户维护费	15,518.12	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	313,931.40	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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
招商银行	31,660,415.90	58,412.74	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

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）发行的股票：招商银行（代码 600036）194,800.00 股，期末公允价值为人民币 8,220,560.00 元，占本基金期末基金资产净

值比例为 1.34%；招商银行（代码 3968）73,500.00 股，期末公允价值为人民币 3,299,964.41 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.54%。

本基金本报告期末投资于基金托管人（招商银行股份有限公司）关联方发行的股票：中国交建（代码 601800）55,600.00 股，期末公允价值为人民币 515,968.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.08%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东（西南证券股份有限公司）发行的股票：西南证券（代码 600369）50,900.00 股，期末公允价值为人民币 202,073.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.03%。

6.4.11 利润分配情况

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	238	22,965.36	20,901.16	锁定期送/转股
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
688302	海创药业	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	42.92	38.35	13,082	561,479.44	501,694.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
00813	世茂集团	2022年4月1日	重大事项停牌	3.78			26,500.00	518,589.22	100,168.40	-
01114	BRILLIANCE CHI	2021年3月31日	重大事项停牌	6.24			118,000.00	697,518.28	736,660.67	-

01918	融创中国	2022 年 4 月 1 日	重大 事项 停牌	3.92			58,000.00	1,479,687. 52	227,172.6 7	-
03333	中国恒大	2022 年 3 月 21 日	重大 事项 停牌	1.41			34,000.00	441,850.87	47,976.16	-
03380	龙光集团	2022 年 5 月 12 日	重大 事项 停牌	1.86			28,000.00	277,366.86	52,200.80	-
06666	恒大物业	2022 年 3 月 21 日	重大 事项 停牌	1.97			75,500.00	545,718.43	148,503.7 4	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：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 2022 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	31,660,415.90	-	-	-	31,660,415.90
结算备付金	47,237.24	-	-	-	47,237.24
存出保证金	14,650.92	-	-	-	14,650.92
交易性金融资产	-	-	-	580,428,124.30	580,428,124.30
应收股利	-	-	-	1,605,894.95	1,605,894.95
资产总计	31,722,304.06	-	-	582,034,019.25	613,756,323.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	244,302.47	244,302.47
应付托管费	-	-	-	48,860.50	48,860.50
应付清算款	-	-	-	49.57	49.57
其他负债	-	-	-	283,808.23	283,808.23
负债总计	-	-	-	577,020.77	577,020.77
利率敏感度缺口	31,722,304.06	-	-	581,456,998.48	613,179,302.54
上年度末 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	36,832,964.50	-	-	-	36,832,964.50
结算备付金	50,977.03	-	-	-	50,977.03
存出保证金	38,481.92	-	-	-	38,481.92
交易性金融资产	-	-	-	696,349,170.73	696,349,170.73

应收股利	-	-	-	50,156.14	50,156.14
应收证券清算款	-	-	-	74,338.24	74,338.24
其他资产	-	-	-	5,830.78	5,830.78
资产总计	36,922,423.45	-	-	696,479,495.89	733,401,919.34
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	322,825.74	322,825.74
应付托管费	-	-	-	64,565.13	64,565.13
应付证券清算款	-	-	-	57.67	57.67
应交税费	-	-	-	43.52	43.52
其他负债	-	-	-	222,746.88	222,746.88
负债总计	-	-	-	610,238.94	610,238.94
利率敏感度缺口	36,922,423.45	-	-	695,869,256.95	732,791,680.40

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：本基金本报告期末及上年度末（如有）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 2022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	-	225,994,355.57	-	225,994,355.57
资产合计	-	225,994,355.57	-	225,994,355.57
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	-	225,994,355.57	-	225,994,355.57
项目	上年度末 2021年12月31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	-	266,942,981.18	-	266,942,981.18
资产合计	-	266,942,981.18	-	266,942,981.18
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	-	266,942,981.18	-	266,942,981.18

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	港币 5%	11,299,717.78	13,347,149.06
	港币-5%	-11,299,717.78	-13,347,149.06

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	580,428,124.30	94.66	696,349,170.73	95.03
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	580,428,124.30	94.66	696,349,170.73	95.03

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%基金资产净值相对应变化带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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	29,552,998.95	32,531,226.15

	业绩比较基准下降 5%	-29, 552, 998. 95	-32, 531, 226. 15
--	----------------	-------------------	-------------------

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	578, 564, 912. 87	695, 171, 179. 14
第二层次	1, 312, 682. 44	5, 504. 49
第三层次	550, 528. 99	1, 172, 487. 10
合计	580, 428, 124. 30	696, 349, 170. 73

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停【、基金处于封闭期】等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6. 4. 14. 4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：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	580,428,124.30	94.57
	其中：股票	580,428,124.30	94.57
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	31,707,653.14	5.17
8	其他各项资产	1,620,545.87	0.26
9	合计	613,756,323.31	100.00

注：1、股票投资含可退替代款估值增值。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 225,994,355.57 元，占期末净值比例为 36.86%。

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	4,046,239.00	0.66
B	采矿业	8,974,828.00	1.46
C	制造业	213,956,438.57	34.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,337,387.00	1.36
E	建筑业	6,193,085.00	1.01
F	批发和零售业	1,434,224.30	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	8,861,269.00	1.45
H	住宿和餐饮业	459,170.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,124,566.77	1.81

J	金融业	69,732,093.54	11.37
K	房地产业	6,231,919.00	1.02
L	租赁和商务服务业	4,687,888.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	5,929,262.40	0.97
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	170,805.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,920,047.23	0.48
R	文化、体育和娱乐业	775,863.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	353,835,085.81	57.70

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	598,682.92	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	598,682.92	0.10

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	2,727,910.71	0.44
消费者非必需品	36,912,258.97	6.02
消费者常用品	10,830,857.35	1.77
能源	5,885,691.24	0.96
金融	72,642,729.12	11.85
医疗保健	10,949,257.55	1.79
工业	9,288,749.66	1.51
信息技术	10,568,331.12	1.72
电信服务	40,913,401.35	6.67
公用事业	7,953,476.11	1.30
地产建筑业	17,321,692.39	2.82
合计	225,994,355.57	36.86

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	107,500	32,581,028.62	5.31
2	600519	贵州茅台	9,900	20,245,500.00	3.30
3	00005	汇丰控股	326,400	14,417,271.93	2.35
4	01299	友邦保险	192,400	13,994,004.19	2.28
5	601318	中国平安	170,600	7,965,314.00	1.30
5	02318	中国平安	119,000	5,429,301.99	0.89
6	03690	美团-W	79,000	13,120,153.94	2.14
7	300750	宁德时代	22,117	11,810,478.00	1.93
8	600036	招商银行	194,800	8,220,560.00	1.34
8	03968	招商银行	73,500	3,299,964.41	0.54
9	00939	建设银行	1,920,000	8,653,154.50	1.41
9	601939	建设银行	105,300	638,118.00	0.10
10	002594	比亚迪	14,400	4,802,256.00	0.78
10	01211	比亚迪股份	14,000	3,759,415.24	0.61
11	01398	工商银行	1,386,000	5,523,466.96	0.90
11	601398	工商银行	551,500	2,630,655.00	0.43
12	00388	香港交易所	20,300	6,701,097.80	1.09
13	601012	隆基绿能	96,060	6,400,477.80	1.04
14	000858	五粮液	30,832	6,225,905.76	1.02
15	000333	美的集团	77,800	4,698,342.00	0.77
16	03988	中国银行	1,335,000	3,573,454.17	0.58

16	601988	中国银行	331,900	1,081,994.00	0.18
17	601166	兴业银行	229,000	4,557,100.00	0.74
18	00941	中国移动	98,000	4,106,622.38	0.67
18	600941	中国移动	7,200	435,600.00	0.07
19	300059	东方财富	167,616	4,257,446.40	0.69
20	02269	药明生物	68,000	4,175,379.66	0.68
21	600900	长江电力	178,800	4,133,856.00	0.67
22	600030	中信证券	153,510	3,325,026.60	0.54
22	06030	中信证券	42,000	630,001.37	0.10
23	603259	药明康德	32,360	3,365,116.40	0.55
23	02359	药明康德	6,300	563,014.34	0.09
24	601888	中国中免	15,500	3,610,415.00	0.59
25	601328	交通银行	432,200	2,152,356.00	0.35
25	03328	交通银行	281,000	1,302,471.47	0.21
26	01810	小米集团-W	280,000	3,266,141.65	0.53
27	600887	伊利股份	81,100	3,158,845.00	0.52
28	01024	快手-W	40,200	3,004,692.96	0.49
29	601899	紫金矿业	228,100	2,128,173.00	0.35
29	02899	紫金矿业	92,000	756,090.58	0.12
30	00981	中芯国际	95,500	1,484,772.33	0.24
30	688981	中芯国际	30,654	1,384,641.18	0.23
31	000568	泸州老窖	11,600	2,859,864.00	0.47
32	600690	海尔智家	60,100	1,650,346.00	0.27
32	06690	海尔智家	46,000	1,142,790.40	0.19
33	601088	中国神华	52,200	1,738,260.00	0.28
33	01088	中国神华	54,000	1,039,055.85	0.17
34	601288	农业银行	503,000	1,519,060.00	0.25
34	01288	农业银行	491,000	1,242,898.94	0.20
35	000002	万 科 A	107,800	2,209,900.00	0.36
35	02202	万科企业	30,600	516,049.01	0.08
36	002415	海康威视	74,800	2,707,760.00	0.44
37	002475	立讯精密	78,600	2,655,894.00	0.43
38	02331	李 宁	42,000	2,611,237.15	0.43
39	02015	理想汽车-W	19,800	2,589,019.31	0.42
40	600276	恒瑞医药	69,740	2,586,656.60	0.42
41	600809	山西汾酒	7,860	2,552,928.00	0.42
42	600438	通威股份	42,500	2,544,050.00	0.41
43	00883	中国海洋石油	286,000	2,533,893.76	0.41
44	000651	格力电器	75,000	2,529,000.00	0.41
45	300760	迈瑞医疗	7,800	2,442,960.00	0.40
46	600309	万华化学	24,600	2,385,954.00	0.39
47	000725	京东方 A	594,100	2,340,754.00	0.38

48	002714	牧原股份	42,200	2,332,394.00	0.38
49	000001	平安银行	153,900	2,305,422.00	0.38
50	002142	宁波银行	62,890	2,252,090.90	0.37
51	00016	新鸿基地产	28,000	2,219,731.16	0.36
52	02628	中国人寿	120,000	1,401,827.45	0.23
52	601628	中国人寿	26,200	814,296.00	0.13
53	09633	农夫山泉	56,400	2,172,883.86	0.35
54	002129	TCL 中环	35,800	2,108,262.00	0.34
55	002812	恩捷股份	8,400	2,103,780.00	0.34
56	00386	中国石油化工股份	408,000	1,231,678.85	0.20
56	600028	中国石化	208,800	851,904.00	0.14
57	09868	小鹏汽车-W	19,200	2,075,443.51	0.34
58	00669	创科实业	29,500	2,064,920.39	0.34
59	000792	盐湖股份	68,400	2,049,264.00	0.33
60	002466	天齐锂业	16,300	2,034,240.00	0.33
61	601601	中国太保	53,900	1,268,267.00	0.21
61	02601	中国太保	44,200	724,992.45	0.12
62	600048	保利发展	114,000	1,990,440.00	0.32
63	603288	海天味业	22,001	1,988,010.36	0.32
64	00001	长和	43,000	1,950,816.67	0.32
65	01658	邮储银行	191,000	1,017,616.24	0.17
65	601658	邮储银行	171,300	923,307.00	0.15
66	603799	华友钴业	20,290	1,940,129.80	0.32
67	300124	汇川技术	29,250	1,926,697.50	0.31
68	600585	海螺水泥	37,300	1,315,944.00	0.21
68	00914	海螺水泥	21,000	610,605.66	0.10
69	300015	爱尔眼科	42,899	1,920,588.23	0.31
70	00857	中国石油股份	338,000	1,081,062.78	0.18
70	601857	中国石油	152,800	809,840.00	0.13
71	002460	赣锋锂业	12,700	1,888,490.00	0.31
72	01109	华润置地	58,000	1,815,397.33	0.30
73	00002	中电控股	32,500	1,809,368.24	0.30
74	02388	中银香港	68,000	1,802,740.52	0.29
75	02020	安踏体育	21,800	1,797,198.89	0.29
76	600031	三一重工	93,500	1,782,110.00	0.29
77	300014	亿纬锂能	18,000	1,755,000.00	0.29
78	601668	中国建筑	329,800	1,754,536.00	0.29
79	600436	片仔癀	4,900	1,747,977.00	0.29
80	002304	洋河股份	9,500	1,739,925.00	0.28
81	002352	顺丰控股	31,000	1,730,110.00	0.28
82	300498	温氏股份	80,500	1,713,845.00	0.28

83	02319	蒙牛乳业	51,000	1,707,515.11	0.28
84	00027	银河娱乐	42,000	1,680,961.46	0.27
85	01113	长实集团	35,000	1,661,206.58	0.27
86	06160	百济神州	19,600	1,651,029.81	0.27
87	002271	东方雨虹	32,000	1,647,040.00	0.27
88	600089	特变电工	59,300	1,624,227.00	0.26
89	300274	阳光电源	16,500	1,621,125.00	0.26
90	601816	京沪高铁	309,700	1,554,694.00	0.25
91	00688	中国海外发展	70,500	1,495,214.20	0.24
92	603986	兆易创新	10,480	1,490,360.80	0.24
93	600837	海通证券	151,900	1,490,139.00	0.24
94	600000	浦发银行	186,000	1,489,860.00	0.24
95	00175	吉利汽车	97,000	1,479,889.19	0.24
96	00011	恒生银行	12,300	1,456,858.92	0.24
97	600016	民生银行	390,300	1,451,916.00	0.24
98	603501	韦尔股份	8,300	1,436,149.00	0.23
99	600406	国电南瑞	52,696	1,422,792.00	0.23
100	601633	长城汽车	19,600	725,984.00	0.12
100	02333	长城汽车	50,000	690,138.33	0.11
101	300122	智飞生物	12,700	1,409,827.00	0.23
102	02688	新奥能源	12,700	1,399,971.69	0.23
103	601919	中远海控	99,770	1,386,803.00	0.23
104	000625	长安汽车	78,884	1,366,270.88	0.22
105	02382	舜宇光学科技	12,400	1,356,297.13	0.22
106	600919	江苏银行	187,500	1,335,000.00	0.22
107	002709	天赐材料	21,300	1,321,878.00	0.22
108	600104	上汽集团	73,900	1,316,159.00	0.21
109	601688	华泰证券	92,600	1,314,920.00	0.21
110	00291	华润啤酒	26,000	1,300,743.99	0.21
111	601225	陕西煤业	61,100	1,294,098.00	0.21
112	00003	香港中华煤气	178,950	1,293,156.32	0.21
113	002049	紫光国微	6,800	1,290,096.00	0.21
114	000063	中兴通讯	50,400	1,286,712.00	0.21
115	002241	歌尔股份	37,900	1,273,440.00	0.21
116	00960	龙湖集团	39,000	1,235,706.79	0.20
117	300142	沃森生物	25,400	1,229,106.00	0.20
118	002230	科大讯飞	29,500	1,215,990.00	0.20
119	000661	长春高新	5,200	1,213,784.00	0.20
120	600111	北方稀土	34,500	1,213,020.00	0.20
121	002459	晶澳科技	14,960	1,180,344.00	0.19
122	02313	申洲国际	14,400	1,170,515.66	0.19
123	002371	北方华创	4,200	1,163,904.00	0.19

124	300450	先导智能	17,480	1,104,386.40	0.18
125	688599	天合光能	16,865	1,100,441.25	0.18
126	002027	分众传媒	160,100	1,077,473.00	0.18
127	601211	国泰君安	70,800	1,076,160.00	0.18
128	06618	京东健康	20,400	1,073,793.67	0.18
129	000338	潍柴动力	86,100	1,073,667.00	0.18
130	601169	北京银行	234,800	1,065,992.00	0.17
131	000100	TCL 科技	221,800	1,062,422.00	0.17
132	600660	福耀玻璃	25,200	1,053,612.00	0.17
133	00066	港铁公司	30,000	1,051,883.70	0.17
134	601229	上海银行	156,884	1,027,590.20	0.17
135	01093	石药集团	154,000	1,025,937.24	0.17
136	601985	中国核电	149,100	1,022,826.00	0.17
137	00006	电能实业	24,000	1,012,887.04	0.17
138	600745	闻泰科技	11,800	1,004,298.00	0.16
139	600050	中国联通	290,000	1,003,400.00	0.16
140	601766	中国中车	191,600	996,320.00	0.16
141	601390	中国中铁	161,900	994,066.00	0.16
142	03800	保利协鑫能源	304,000	985,315.71	0.16
143	600522	中天科技	42,600	984,060.00	0.16
144	600893	航发动力	21,200	964,812.00	0.16
145	00267	中信股份	141,000	958,625.23	0.16
146	06098	碧桂园服务	32,000	956,444.50	0.16
147	601669	中国电建	119,300	938,891.00	0.15
148	300347	泰格医药	8,200	938,490.00	0.15
149	01997	九龙仓置业	29,000	927,539.07	0.15
150	603659	璞泰来	10,980	926,712.00	0.15
151	00881	中升控股	19,500	923,027.95	0.15
152	01821	ESR	50,200	910,127.41	0.15
153	00968	信义光能	86,000	891,381.64	0.15
154	601615	明阳智能	26,300	888,940.00	0.14
155	000776	广发证券	46,900	877,030.00	0.14
156	600009	上海机场	15,200	861,840.00	0.14
157	600905	三峡能源	136,400	857,956.00	0.14
158	600958	东方证券	83,120	848,655.20	0.14
159	601009	南京银行	81,400	848,188.00	0.14
160	600019	宝钢股份	140,800	847,616.00	0.14
161	600010	包钢股份	358,800	843,180.00	0.14
162	600999	招商证券	58,300	840,103.00	0.14
163	300896	爱美客	1,400	840,014.00	0.14
164	600196	复星医药	19,000	837,710.00	0.14
165	01928	金沙中国有限公	52,000	832,476.15	0.14

		司			
166	002410	广联达	15,100	822,044.00	0.13
167	600570	恒生电子	18,540	807,231.60	0.13
168	000895	双汇发展	27,400	802,820.00	0.13
169	002179	中航光电	12,540	794,032.80	0.13
170	000733	振华科技	5,800	788,626.00	0.13
171	601818	光大银行	261,500	787,115.00	0.13
172	002311	海大集团	13,100	786,131.00	0.13
173	002050	三花智控	28,500	783,180.00	0.13
174	02328	中国财险	112,000	781,575.24	0.13
175	01177	中国生物制药	180,000	765,052.97	0.12
176	600760	中航沈飞	12,429	751,333.05	0.12
177	00288	万洲国际	144,000	746,273.00	0.12
178	002493	荣盛石化	48,150	741,028.50	0.12
179	600346	恒力石化	33,300	740,592.00	0.12
180	00322	康师傅控股	64,000	735,600.23	0.12
181	300759	康龙化成	7,650	728,433.00	0.12
182	00992	联想集团	116,000	727,150.95	0.12
183	002074	国轩高科	15,900	725,040.00	0.12
184	00868	信义玻璃	45,000	724,260.41	0.12
185	300661	圣邦股份	3,975	723,529.50	0.12
186	00268	金蝶国际	45,000	708,097.32	0.12
187	300496	中科创达	5,400	704,592.00	0.11
188	01801	信达生物	23,500	701,384.08	0.11
189	600926	杭州银行	46,800	701,064.00	0.11
190	300782	卓胜微	5,184	699,840.00	0.11
191	002821	凯莱英	2,400	693,600.00	0.11
192	688012	中微公司	5,927	691,977.25	0.11
193	600460	士兰微	13,300	691,600.00	0.11
194	300316	晶盛机电	10,200	689,418.00	0.11
195	002340	格林美	75,600	687,960.00	0.11
196	000799	酒鬼酒	3,700	687,497.00	0.11
197	600426	华鲁恒升	23,460	685,032.00	0.11
198	000538	云南白药	11,320	683,614.80	0.11
199	001979	招商蛇口	50,300	675,529.00	0.11
200	002001	新和成	29,500	672,895.00	0.11
201	000768	中航西飞	21,900	663,351.00	0.11
202	600176	中国巨石	37,994	661,475.54	0.11
203	601989	中国重工	177,700	659,267.00	0.11
204	002920	德赛西威	4,400	651,200.00	0.11
205	002202	金风科技	44,000	651,200.00	0.11
206	000596	古井贡酒	2,600	649,116.00	0.11

207	00788	中国铁塔	746,000	644,351.46	0.11
208	603993	洛阳钼业	110,900	635,457.00	0.10
209	600763	通策医疗	3,600	627,984.00	0.10
210	000963	华东医药	13,900	627,724.00	0.10
211	601138	工业富联	62,900	618,936.00	0.10
212	00083	信和置业	62,000	613,992.21	0.10
213	601006	大秦铁路	93,100	613,529.00	0.10
214	601877	正泰电器	17,100	611,838.00	0.10
215	00004	九龙仓集团	25,000	611,460.85	0.10
216	000166	申万宏源	142,500	611,325.00	0.10
217	02007	碧桂园	147,000	610,964.84	0.10
218	300012	华测检测	26,300	610,423.00	0.10
219	01929	周大福	48,200	608,409.53	0.10
220	600584	长电科技	22,500	607,500.00	0.10
221	300207	欣旺达	19,100	603,560.00	0.10
222	06969	思摩尔国际	29,000	600,172.34	0.10
223	601066	中信建投	20,600	595,546.00	0.10
224	600600	青岛啤酒	5,700	592,344.00	0.10
225	601377	兴业证券	83,800	590,790.00	0.10
226	600588	用友网络	27,136	589,122.56	0.10
227	601600	中国铝业	123,300	585,675.00	0.10
228	688111	金山办公	2,969	585,249.28	0.10
229	600029	南方航空	79,200	578,952.00	0.09
230	00012	恒基地产	23,000	578,279.48	0.09
231	00017	新世界发展	24,000	577,766.36	0.09
232	601186	中国铁建	72,900	575,910.00	0.09
233	600132	重庆啤酒	3,900	571,740.00	0.09
234	600383	金地集团	42,500	571,200.00	0.09
235	600741	华域汽车	24,800	570,400.00	0.09
236	601838	成都银行	34,400	570,352.00	0.09
237	002180	纳思达	11,200	566,944.00	0.09
238	600188	兖矿能源	14,300	564,564.00	0.09
239	00151	中国旺旺	96,000	559,910.00	0.09
240	688005	容百科技	4,308	557,627.52	0.09
241	000786	北新建材	16,100	557,382.00	0.09
242	600085	同仁堂	10,500	555,240.00	0.09
243	300408	三环集团	18,400	553,840.00	0.09
244	01876	百威亚太	27,500	552,666.54	0.09
245	06186	中国飞鹤	71,000	547,680.78	0.09
246	601111	中国国航	47,100	546,831.00	0.09
247	600885	宏发股份	13,020	544,887.00	0.09
248	000876	新希望	35,600	544,680.00	0.09

249	603806	福斯特	8,260	541,195.20	0.09
250	300751	迈为股份	1,100	539,990.00	0.09
251	601117	中国化学	57,300	539,193.00	0.09
252	603019	中科曙光	18,400	533,968.00	0.09
253	601238	广汽集团	34,900	531,876.00	0.09
254	600150	中国船舶	28,000	531,440.00	0.09
255	03323	中国建材	74,000	530,320.42	0.09
256	003816	中国广核	187,600	525,280.00	0.09
257	600547	山东黄金	28,300	525,248.00	0.09
258	601800	中国交建	55,600	515,968.00	0.08
259	300763	锦浪科技	2,400	511,200.00	0.08
260	600989	宝丰能源	34,700	508,355.00	0.08
261	600884	杉杉股份	17,100	508,212.00	0.08
262	601100	恒立液压	8,200	506,104.00	0.08
263	688396	华润微	8,504	502,331.28	0.08
264	00998	中信银行	167,000	501,286.72	0.08
265	600015	华夏银行	96,100	500,681.00	0.08
266	300999	金龙鱼	9,200	496,984.00	0.08
267	002648	卫星化学	19,209	496,552.65	0.08
268	002384	东山精密	21,600	495,288.00	0.08
269	603369	今世缘	9,700	494,700.00	0.08
270	01038	长江基建集团	12,000	493,615.67	0.08
271	000723	美锦能源	40,400	492,880.00	0.08
272	600886	国投电力	46,700	490,350.00	0.08
273	000157	中联重科	79,000	486,640.00	0.08
274	01548	金斯瑞生物科技	20,000	486,603.11	0.08
275	601689	拓普集团	7,100	485,853.00	0.08
276	601868	中国能建	203,300	481,821.00	0.08
277	600011	华能国际	68,400	481,536.00	0.08
278	300601	康泰生物	10,640	480,715.20	0.08
279	601788	光大证券	30,500	480,680.00	0.08
280	000301	东方盛虹	28,400	480,244.00	0.08
281	603185	上机数控	3,060	477,329.40	0.08
282	600115	中国东航	85,600	469,944.00	0.08
283	002236	大华股份	28,600	469,612.00	0.08
284	000425	徐工机械	86,600	466,774.00	0.08
285	02618	京东物流	31,800	465,579.12	0.08
286	03888	金山软件	17,600	460,571.13	0.08
287	01193	华润燃气	14,700	459,480.76	0.07
288	600754	锦江酒店	7,300	459,170.00	0.07
289	00101	恒隆地产	36,000	458,108.18	0.07
290	300595	欧普康视	8,000	457,520.00	0.07

291	002601	龙佰集团	22,600	453,130.00	0.07
292	002555	三七互娱	21,300	452,199.00	0.07
293	603486	科沃斯	3,700	450,993.00	0.07
294	603816	顾家家居	7,930	449,075.90	0.07
295	01378	中国宏桥	59,000	447,546.58	0.07
296	688008	澜起科技	7,365	446,171.70	0.07
297	00836	华润电力	32,000	443,330.50	0.07
298	603392	万泰生物	2,845	441,828.50	0.07
299	300628	亿联网络	5,800	441,670.00	0.07
300	09992	泡泡玛特	13,600	440,799.13	0.07
301	002008	大族激光	13,300	440,629.00	0.07
302	002736	国信证券	45,900	439,263.00	0.07
303	000938	紫光股份	22,600	438,440.00	0.07
304	605358	立昂微	6,500	437,970.00	0.07
305	603833	欧派家居	2,900	436,972.00	0.07
306	601555	东吴证券	62,978	436,437.54	0.07
307	600233	圆通速递	21,200	432,268.00	0.07
308	000977	浪潮信息	16,300	431,624.00	0.07
309	00586	海螺创业	29,500	431,400.60	0.07
310	601901	方正证券	63,700	427,427.00	0.07
311	601336	新华保险	13,200	424,908.00	0.07
312	603290	斯达半导	1,100	424,490.00	0.07
313	06862	海底捞	27,000	422,549.38	0.07
314	000069	华侨城 A	64,900	421,201.00	0.07
315	688180	君实生物	5,546	417,835.64	0.07
316	01308	海丰国际	22,000	417,674.80	0.07
317	601233	桐昆股份	26,300	417,644.00	0.07
318	600219	南山铝业	112,500	415,125.00	0.07
319	300454	深信服	4,000	415,120.00	0.07
320	603260	合盛硅业	3,500	412,860.00	0.07
321	002385	大北农	52,500	410,025.00	0.07
322	002841	视源股份	5,400	406,728.00	0.07
323	00241	阿里健康	88,000	406,386.29	0.07
324	300363	博腾股份	5,200	405,548.00	0.07
325	600845	宝信软件	7,350	401,310.00	0.07
326	601108	财通证券	50,840	400,110.80	0.07
327	688099	晶晨股份	3,960	399,960.00	0.07
328	300529	健帆生物	7,800	396,942.00	0.06
329	002007	华兰生物	17,400	396,720.00	0.06
330	601995	中金公司	8,900	395,961.00	0.06
331	300413	芒果超媒	11,800	393,648.00	0.06
332	601799	星宇股份	2,300	393,300.00	0.06

333	601618	中国中冶	112,200	392,700.00	0.06
334	002120	韵达股份	22,800	388,968.00	0.06
335	603345	安井食品	2,300	386,101.00	0.06
336	00135	昆仑能源	70,000	384,921.02	0.06
337	688126	沪硅产业	16,710	383,995.80	0.06
338	300144	宋城演艺	24,900	382,215.00	0.06
339	601360	三六零	44,800	381,696.00	0.06
340	002252	上海莱士	64,300	381,299.00	0.06
341	01044	恒安国际	12,000	378,165.02	0.06
342	002013	中航机电	30,600	377,910.00	0.06
343	603882	金域医学	4,500	371,475.00	0.06
344	300003	乐普医疗	20,000	371,400.00	0.06
345	600298	安琪酵母	7,600	370,500.00	0.06
346	688169	石头科技	600	370,020.00	0.06
347	000783	长江证券	61,800	366,474.00	0.06
348	01209	华润万象生活	11,000	365,935.80	0.06
349	000703	恒逸石化	34,800	365,748.00	0.06
350	601155	新城控股	14,300	363,649.00	0.06
351	688536	思瑞浦	647	363,348.73	0.06
352	300919	中伟股份	2,900	359,310.00	0.06
353	00384	中国燃气	34,600	358,625.64	0.06
354	00316	东方海国际	2,000	355,759.04	0.06
355	601077	渝农商行	95,400	352,980.00	0.06
356	300433	蓝思科技	31,800	352,026.00	0.06
357	300146	汤臣倍健	16,200	350,730.00	0.06
358	600332	白云山	11,100	350,649.00	0.06
359	601696	中银证券	26,100	347,130.00	0.06
360	601878	浙商证券	30,300	344,814.00	0.06
361	002602	世纪华通	70,900	341,738.00	0.06
362	603517	绝味食品	5,900	341,138.00	0.06
363	688036	传音控股	3,819	340,769.37	0.06
364	603589	口子窖	5,800	339,938.00	0.06
365	00019	太古股份公司 A	8,500	339,831.13	0.06
366	01066	威高股份	43,200	336,931.18	0.05
367	002185	华天科技	35,800	335,804.00	0.05
368	600918	中泰证券	43,600	333,540.00	0.05
369	600674	川投能源	27,900	332,568.00	0.05
370	000066	中国长城	30,700	332,174.00	0.05
371	603899	晨光股份	5,900	330,872.00	0.05
372	300223	北京君正	3,100	329,375.00	0.05
373	002938	鹏鼎控股	10,900	329,289.00	0.05
374	601727	上海电气	79,800	327,978.00	0.05

375	300033	同花顺	3,400	326,910.00	0.05
376	000708	中信特钢	16,000	322,400.00	0.05
377	601728	中国电信	85,100	317,423.00	0.05
378	601636	旗滨集团	24,800	316,200.00	0.05
379	601607	上海医药	17,400	314,592.00	0.05
380	600109	国金证券	34,900	314,100.00	0.05
381	00762	中国联通	98,000	310,929.98	0.05
382	603737	三棵树	2,400	310,632.00	0.05
383	01972	太古地产	18,600	309,859.28	0.05
384	002916	深南电路	3,300	309,243.00	0.05
385	600183	生益科技	18,200	309,218.00	0.05
386	002624	完美世界	21,500	308,955.00	0.05
387	00285	比亚迪电子	14,500	306,906.31	0.05
388	300957	贝泰妮	1,400	304,542.00	0.05
389	601865	福莱特	7,900	300,990.00	0.05
390	603939	益丰药房	5,690	300,602.70	0.05
391	601898	中煤能源	28,800	298,944.00	0.05
392	00270	粤海投资	42,000	298,119.23	0.05
393	600018	上港集团	51,000	297,330.00	0.05
394	600779	水井坊	3,200	296,128.00	0.05
395	600362	江西铜业	16,400	292,412.00	0.05
396	600705	中航产融	84,200	291,332.00	0.05
397	601990	南京证券	34,900	291,066.00	0.05
398	300676	华大基因	4,000	286,800.00	0.05
399	002080	中材科技	10,400	286,000.00	0.05
400	00853	微创医疗	14,500	282,105.80	0.05
401	002673	西部证券	42,600	278,604.00	0.05
402	002508	老板电器	7,600	273,828.00	0.04
403	00144	招商局港口	24,000	273,797.63	0.04
404	002791	坚朗五金	2,100	272,412.00	0.04
405	03692	翰森制药	20,000	270,924.19	0.04
406	002414	高德红外	20,996	270,218.52	0.04
407	00772	阅文集团	8,200	265,775.95	0.04
408	600143	金发科技	27,800	264,656.00	0.04
409	000728	国元证券	41,900	260,618.00	0.04
410	600161	天坛生物	10,600	257,368.00	0.04
411	601216	君正集团	52,600	256,688.00	0.04
412	000408	藏格矿业	7,700	253,638.00	0.04
413	002568	百润股份	8,440	253,537.60	0.04
414	601319	中国人保	49,900	252,494.00	0.04
415	00656	复星国际	40,000	248,005.10	0.04
416	600803	新奥股份	13,300	247,247.00	0.04

417	00884	旭辉控股集团	73,112	246,347.13	0.04
418	603893	瑞芯微	2,700	245,538.00	0.04
419	01691	JS 环球生活	28,000	244,721.17	0.04
420	06110	滔搏	40,000	243,900.19	0.04
421	300558	贝达药业	4,000	243,200.00	0.04
422	600079	人福医药	15,100	241,600.00	0.04
423	601966	玲珑轮胎	9,500	241,015.00	0.04
424	688363	华熙生物	1,629	231,611.22	0.04
425	300832	新产业	5,100	230,061.00	0.04
426	600372	中航电子	11,800	228,802.00	0.04
427	01918	融创中国	58,000	227,172.67	0.04
428	01999	敏华控股	31,200	226,262.75	0.04
429	002600	领益智造	44,600	223,892.00	0.04
430	601198	东兴证券	25,100	223,390.00	0.04
431	688185	康希诺	1,092	217,395.36	0.04
432	00754	合生创展集团	20,900	214,124.18	0.03
433	003022	联泓新科	6,400	212,672.00	0.03
434	600038	中直股份	4,700	212,440.00	0.03
435	01313	华润水泥控股	46,000	207,315.16	0.03
436	00909	明源云	19,000	204,082.54	0.03
437	600369	西南证券	50,900	202,073.00	0.03
438	000050	深天马 A	19,800	197,406.00	0.03
439	002064	华峰化学	23,200	195,808.00	0.03
440	600025	华能水电	28,000	195,720.00	0.03
441	601881	中国银河	20,100	194,367.00	0.03
442	01579	颐海国际	8,000	193,615.02	0.03
443	02588	中银航空租赁	3,400	191,759.25	0.03
444	603233	大参林	6,112	191,305.60	0.03
445	00966	中国太平	22,800	188,743.85	0.03
446	300677	英科医疗	7,260	184,113.60	0.03
447	688187	时代电气	2,766	179,762.34	0.03
448	02018	瑞声科技	11,500	177,614.41	0.03
449	01833	平安好医生	8,900	176,960.19	0.03
450	02689	玖龙纸业	31,000	176,032.31	0.03
451	603087	甘李药业	3,600	172,692.00	0.03
452	300866	安克创新	2,600	172,432.00	0.03
453	002607	中公教育	29,500	170,805.00	0.03
454	603707	健友股份	5,970	168,354.00	0.03
455	000987	越秀金控	23,830	167,524.90	0.03
456	06993	蓝月亮集团	28,000	160,433.64	0.03
457	002153	石基信息	9,880	156,795.60	0.03
458	00293	国泰航空	21,000	154,267.72	0.03

459	002939	长城证券	15,000	152,400.00	0.02
460	601231	环旭电子	10,400	149,344.00	0.02
461	06666	恒大物业	75,500	148,503.74	0.02
462	002032	苏泊尔	2,600	146,484.00	0.02
463	300888	稳健医疗	2,100	139,650.00	0.02
464	000800	一汽解放	14,800	138,232.00	0.02
465	601808	中海油服	9,200	128,340.00	0.02
466	605499	东鹏饮料	700	119,602.00	0.02
467	000877	天山股份	9,600	118,080.00	0.02
468	01128	永利澳门	25,600	116,688.97	0.02
469	300979	华利集团	1,500	109,620.00	0.02
470	06699	时代天使	800	107,548.69	0.02
471	06808	高鑫零售	46,500	101,404.15	0.02
472	00813	世茂集团	26,500	100,168.40	0.02
473	601825	沪农商行	15,000	94,050.00	0.02
474	01516	融创服务	20,000	81,585.13	0.01
475	03380	龙光集团	28,000	52,200.80	0.01
476	001289	龙源电力	2,300	50,048.00	0.01
477	03333	中国恒大	34,000	47,976.16	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	01114	BRILLIANCE CHI	118,000	736,660.67	0.12
2	688302	海创药业	13,082	501,694.70	0.08
3	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
4	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
5	301219	腾远钴业	238	20,901.16	0.00
6	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
7	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000792	盐湖股份	2,235,423.00	0.31
2	02015	理想汽车-W	2,091,177.02	0.29
3	002466	天齐锂业	1,982,582.00	0.27
4	09868	小鹏汽车-W	1,722,047.78	0.23
5	600519	贵州茅台	1,473,447.00	0.20
6	00700	腾讯控股	1,325,717.77	0.18
7	300750	宁德时代	1,145,163.00	0.16

8	01024	快手-W	979,778.24	0.13
9	03800	保利协鑫能源	897,216.17	0.12
10	601615	明阳智能	728,989.00	0.10
11	000733	振华科技	703,401.76	0.10
12	002340	格林美	649,785.00	0.09
13	03690	美团-W	617,988.62	0.08
14	300012	华测检测	599,036.00	0.08
15	688302	海创药业	561,479.44	0.08
16	600941	中国移动	465,303.00	0.06
16	00941	中国移动	84,174.59	0.01
17	600085	同仁堂	538,172.00	0.07
18	02359	药明康德	509,541.38	0.07
18	603259	药明康德	10,303.00	0.00
19	000725	京东方 A	519,226.00	0.07
20	600885	宏发股份	515,575.00	0.07

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	6,106,107.09	0.83
2	03690	美团-W	5,801,788.84	0.79
3	300750	宁德时代	2,620,398.50	0.36
4	00005	汇丰控股	2,546,914.32	0.35
5	01299	友邦保险	2,256,433.73	0.31
6	00939	建设银行	1,621,154.03	0.22
6	601939	建设银行	15,471.00	0.00
7	002594	比亚迪	825,420.00	0.11
7	01211	比亚迪股份	460,752.56	0.06
8	02318	中国平安	856,857.28	0.12
8	601318	中国平安	230,788.52	0.03
9	000858	五粮液	1,049,610.40	0.14
10	09618	京东集团-SW	1,043,808.30	0.14
11	00388	香港交易所	1,021,048.33	0.14
12	01398	工商银行	937,222.65	0.13
12	601398	工商银行	75,291.20	0.01
13	000333	美的集团	972,418.45	0.13
14	688223	晶科能源	809,095.19	0.11
15	300059	东方财富	794,095.00	0.11
16	03968	招商银行	595,021.50	0.08
16	600036	招商银行	198,871.26	0.03
17	600887	伊利股份	786,419.61	0.11

18	688075	安旭生物	745,709.46	0.10
19	00941	中国移动	692,619.46	0.09
20	300760	迈瑞医疗	656,854.00	0.09

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	52,360,216.20
卖出股票收入（成交）总额	88,097,977.84

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	14,650.92

2	应收清算款	-
3	应收股利	1,605,894.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,620,545.87

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	01114	BRILLIANCE CHI	736,660.67	0.12	重大事项停牌
2	688302	海创药业	501,694.70	0.08	新股流通受限
3	301122	采纳股份	21,181.37	0	新股流通受限
4	301219	腾远钴业	20,901.16	0	新股流通受限

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

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 (%)
18,311	41,111.52	33,823,924.00	4.49	718,969,076.00	95.51

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	招商证券股份有限公司	8,487,600.00	1.13

2	方正证券股份有限公司	5,067,200.00	0.67
3	竞技世界(北京)网络技术有限公司	5,000,000.00	0.66
4	周勇	3,000,000.00	0.40
5	但钧	3,000,000.00	0.40
6	郑碧珍	3,000,000.00	0.40
7	四川省宜宾晶鹏玻璃制品有限公司	3,000,000.00	0.40
8	那秀影	3,000,000.00	0.40
9	王东博	2,952,800.00	0.39
10	福州经济技术开发区数为私募基金管理有限公司—数为道策套利六号私募证券投资基金	2,914,900.00	0.39

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年2月4日)基金份额总额	1,482,793,000.00
本报告期期初基金份额总额	842,793,000.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	120,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	752,793,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

2022 年 3 月 1 日,本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告,经本基金管理人董事会批准,张轶先生自 2022 年 2 月 28 日起担任本基金管理人首席信息官职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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(%)	
华泰证券有限责任公司	2	55,952,111.47	40.5	44,749.99	42.68	-
中泰证券股份有限公司	1	30,501,611.41	22.08	22,303.85	21.27	-
广发证券股份有限公司	2	27,183,617.16	19.68	19,879.75	18.96	-

公司						
华创证券 有限责任 公司	1	17,344,626.0 5	12.56	12,684.97	12.10	-
华西证券 股份有限 公司	2	7,163,951.48	5.19	5,239.42	5.00	-
中信建投 证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
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 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
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	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

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(%)
华泰证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2022 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	2022 年 01 月 14 日
2	《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	2022 年 01 月 14 日
3	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公	四大证券报	2022 年 01 月 21 日

	告》		
5	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 01 月 24 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于增加开源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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 02 月 28 日
7	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 03 月 28 日
8	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 29 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 03 月 29 日
10	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 04 月 12 日
11	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 20 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 04 月 20 日
13	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 04 月 25 日
14	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 05 月 06 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构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, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2022 年 06 月 17 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 06 月 20 日
17	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 06 月 28 日

公告》		
-----	--	--

§ 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华货币市场证券投资基金设立的文件
- 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

2022 年 8 月 29 日