

# 银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 年 3 月 31 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 2023 年 03 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>70</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 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（扩位证券简称：MSCI 中国 ETF）
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	138,805,582.00 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

### 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现 收益	-14,507,006.53	65,538,285.16	192,714,385.94
本期利润	-40,561,003.81	23,475,774.93	173,356,948.47
加权平均基 金份额本期 利润	-0.2760	0.1258	0.3044
本期加权平 均净值利润 率	-20.38%	8.22%	27.53%
本期基金份 额净值增长 率	-18.35%	7.43%	40.67%
3.1.2 期末 数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分	40,410,787.19	82,431,904.41	107,998,319.23

配利润			
期末可供分配基金份额利润	0.2911	0.5813	0.4720
期末基金资产净值	179,216,369.19	224,237,486.41	336,803,901.23
期末基金份额净值	1.2911	1.5813	1.4720
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	29.11%	58.13%	47.20%

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。

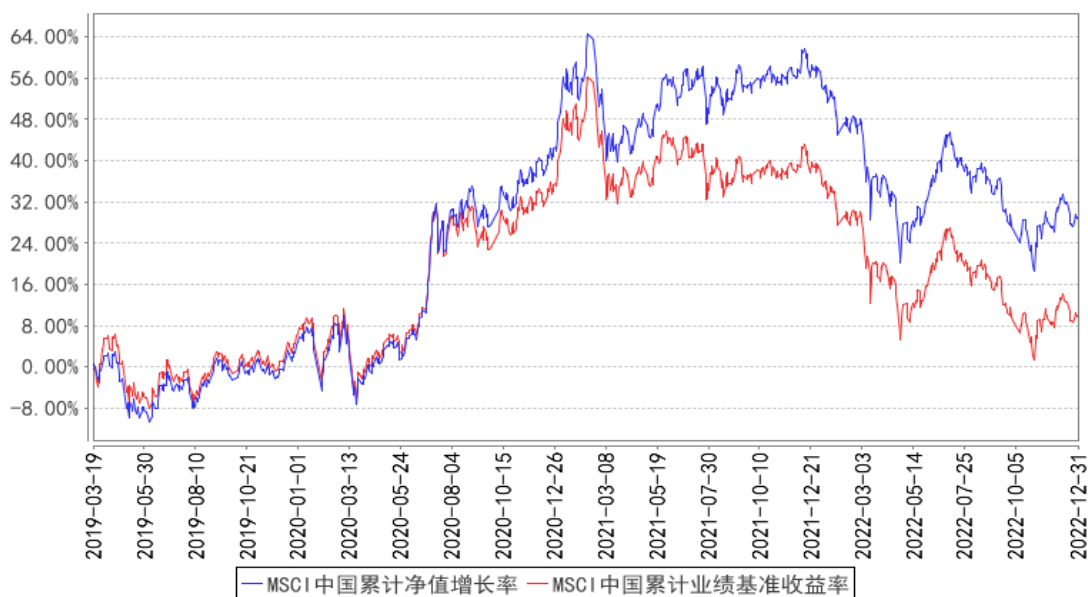
## 3.2 基金净值表现

### 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	1.97%	1.17%	1.03%	1.22%	0.94%	-0.05%
过去六个月	-10.92%	1.03%	-13.04%	1.07%	2.12%	-0.04%
过去一年	-18.35%	1.24%	-20.93%	1.27%	2.58%	-0.03%
过去三年	23.38%	1.28%	3.49%	1.30%	19.89%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.11%	1.24%	10.08%	1.26%	19.03%	-0.02%

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

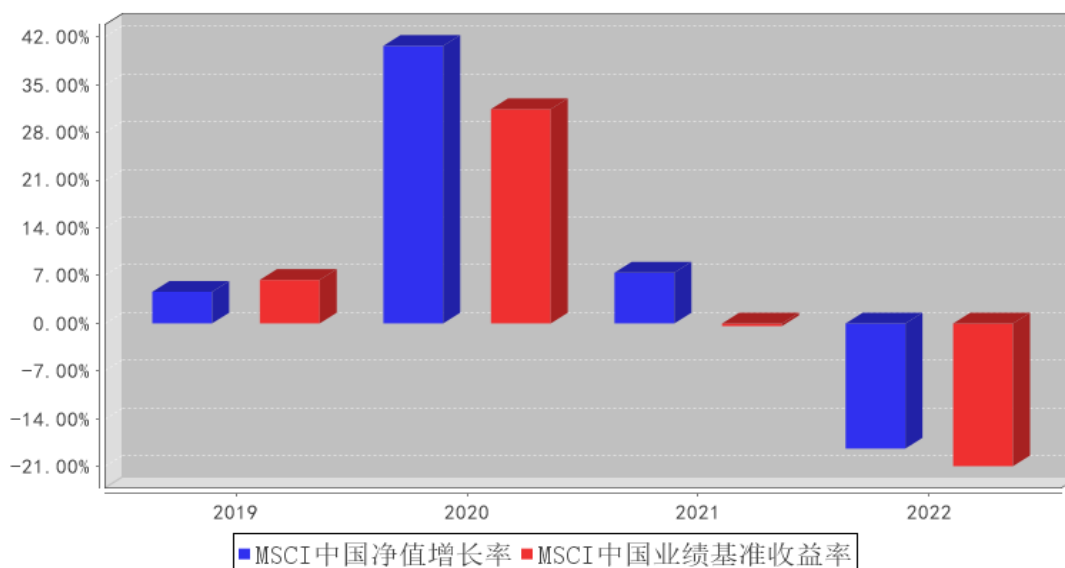
MSCI 中国累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，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2022年、2021年以及2020年未进行利润分配。



## § 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 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 183 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、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、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、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周鹏生	本基金的基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	14.5 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 日至 2022 年 8 月 5 日兼任银华 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。
谭普先生	本基金的基金经理助理	2021 年 4 月 19 日	-	9 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。

#### 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32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1.2911元；本报告期基金份额净值增长率为-18.35%，业绩比较基准收益率为-20.93%。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

2022 年，疫情的变化与应对成为国内经济活动的主要变量。伴随奥密克戎的变异、输入与扩展，疫情防控策略经历了多次优化与迭代。在这一环境下，经济活动在不同时期也面临不同的约束条件。进入四季度后，疫情防控策略进行了重大调整，伴随“二十条”和“新十条”等防疫指导规定的出台，疫情防控的核心防线由社区下沉至家庭和个人。在此过程中，各地的疫情状态先后进入转换期。海外方面，俄乌冲突的爆发与升级成为重要的地缘冲突变量。截至年末，这一冲突仍处于相持阶段，全球能源价格、供应链都在一定程度上受其影响。A 股市场主要指数在 2022 年普遍表现不佳。

展望 2023 年我们认为，伴随疫情防控策略的迭代转换，经济和市场的核心逻辑也相应有所转变。在过去两年动态清零的整体防控策略下，经济核心逻辑是在疫情防控与经济活动之间寻找一个平衡点；而在防控策略转换后，未来一段时期的经济逻辑则更多体现为需求的缓慢复苏与供给的重新梳理。劳动参与率、二次疫情、病毒变异等指标成为重要的边际影响指标，我们对市场理解角度也需要进行相应的转变。

#### 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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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 2022 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(23)第 P01540 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	<p>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金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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 2022 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而导致的重大错</p>



审计报告日期	2023 年 03 月 29 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,501,549.75	9,607,496.09
结算备付金		2,155,186.75	4,531,187.05
存出保证金		412,849.69	1,685,846.53
交易性金融资产	7.4.7.2	170,772,068.97	209,181,142.46
其中：股票投资		170,772,068.97	209,181,142.46
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	2,290,804.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	3,309.99
资产总计		179,841,655.16	227,299,786.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		136,601.35	2,604,922.25

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		78,359.11	97,120.37
应付托管费		15,671.85	19,424.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	7,700.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	394,653.66	333,133.58
负债合计		625,285.97	3,062,300.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	138,805,582.00	141,805,582.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	40,410,787.19	82,431,904.41
净资产合计		179,216,369.19	224,237,486.41
负债和净资产总计		179,841,655.16	227,299,786.84

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2911 元，基金份额总额 138,805,582.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-38,944,829.55	26,500,465.86
1. 利息收入		82,836.51	67,192.52
其中：存款利息收入	7.4.7.13	82,836.51	67,192.52
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）		-13,170,924.82	68,088,324.35
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-15,946,156.27	62,980,683.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-1,171,609.08	998,517.47
股利收益	7.4.7.19	3,946,840.53	4,109,123.51
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）	7.4.7.20	-26,053,997.28	-42,062,510.23
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	197,256.04	407,459.22
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,616,174.26</b>	<b>3,024,690.93</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	996,634.17	1,431,209.71
2. 托管费	7.4.10.2.2	199,326.87	286,242.03
3. 销售服务费		-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		21.88	3,594.66
8. 其他费用	7.4.7.23	420,191.34	1,303,644.53
<b>三、利润总额（亏损总额   以“-”号填列）</b>		<b>-40,561,003.81</b>	<b>23,475,774.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”   号填列）</b>		<b>-40,561,003.81</b>	<b>23,475,774.93</b>
<b>五、其他综合收益的税后   净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-40,561,003.81</b>	<b>23,475,774.93</b>

### 7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	141,805,582.00	-	82,431,904.41	224,237,486.41

资产(基金净值)				
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)	141,805,582.00	-	82,431,904.41	224,237,486.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-42,021,117.22	-45,021,117.22
(一)、综合收益总额	-	-	-40,561,003.81	-40,561,003.81
(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)	-3,000,000.00	-	-1,460,113.41	-4,460,113.41
其中:1.基金申购款	144,000,000.00	-	50,346,572.19	194,346,572.19
2.基金赎回款	-147,000,000.00	-	-51,806,685.60	-198,806,685.60
(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、本期期末净资产(基金净值)	138,805,582.00	-	40,410,787.19	179,216,369.19
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	228,805,582.00	-	107,998,319.23	336,803,901.23
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)	228,805,582.00	-	107,998,319.23	336,803,901.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-87,000,000.00	-	-25,566,414.82	-112,566,414.82
(一)、综合收益总额	-	-	23,475,774.93	23,475,774.93
(二)、本期基	-87,000,000.00	-	-49,042,189.75	-136,042,189.75

金份额 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	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
(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 期末净 资产(基 金净值)	141,805,582.00	-	82,431,904.41	224,237,486.41

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

基金管理人负责人

凌宇翔

主管会计工作负责人

伍军辉

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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

本基金会计年度采用公历年度，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

###### 1. 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产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和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### 2. 金融负债分类

本基金将持有的金融负债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。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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他

金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，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。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。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基于公允价值的

输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。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原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)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或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项

中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例, 损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内, 按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额, 逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债, 根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后, 逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内, 按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时, 其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额, 确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认, 由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认, 并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

##### (4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 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费用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。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

#### 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，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

(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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在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、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、

市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24 号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《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”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《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。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。本基金执行新金融工具准则的影响如下:

于 2021 年 12 月 31 日,银行存款按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,607,496.09 元,按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 9,608,542.98 元,其中应收利息人民币 1,046.89 元,重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日,结算备付金按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,531,187.05 元,按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 4,533,438.27 元,其中应收利息人民币 2,251.22 元,重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日,存出保证金按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,685,846.53 元,按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 1,685,858.41 元,其中应收利息人民币 11.88 元,重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日,交易性金融资产按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 209,181,142.46 元,按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 209,181,142.46 元。

于 2021 年 12 月 31 日,应收利息按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,309.99 元,按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 0 元,其中转出至银行存款人民币 1,046.89 元,转出至结算备付金为人民币 2,251.22 元,转出至存出保证金人民币 11.88 元,转

出至交易性金融资产人民币 0 元。

#### 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]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]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;2018 年 1 月 1 日起,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,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,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。



## 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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	活期存款	6,501,549.75		9,607,496.09
等于：本金	6,500,859.83		9,607,496.09	
加：应计利息	689.92		-	
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	6,501,549.75		9,607,496.09	

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	183,833,664.56	-	170,772,068.97	-13,061,595.59
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	183,833,664.56	-	170,772,068.97	-13,061,595.59
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	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

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	2,407,840.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,407,840.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,407,840.00	-	-	
项目	上年度末 2021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	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	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于2022年12月31日所有的股指期货合约

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：IC2306 买入持仓量 2 手，合约市值人民币 2,323,760.00 元，公允价值变动人民币-84,080.00 元。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2306	IC2306	2.00	2,323,760.00	-84,080.00
合计				-84,080.00
减：可抵销期货暂收款				-84,080.00
净额				0.00

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 7.4.7.5 债权投资

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

注：无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	3,309.99
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	3,309.99

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-

应付交易费用	56,773.25	94,916.51
其中：交易所市场	56,773.25	94,916.51
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	167,880.41	68,217.07
合计	394,653.66	333,133.58

#### 7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,805,582.00	141,805,582.00
本期申购	144,000,000.00	144,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-147,000,000.00	-147,000,000.00
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	138,805,582.00	138,805,582.00

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 7.4.7.12 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	118,401,684.91	-35,969,780.50	82,431,904.41
本期利润	-14,507,006.53	-26,053,997.28	-40,561,003.81
本期基金份额交易产生的变动数	-1,255,193.36	-204,920.05	-1,460,113.41
其中：基金申购款	115,367,336.39	-65,020,764.20	50,346,572.19
基金赎回款	-116,622,529.75	64,815,844.15	-51,806,685.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,639,485.02	-62,228,697.83	40,410,787.19

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	23,055.70	41,196.32
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	59,416.66	25,423.34
其他	364.15	572.86
合计	82,836.51	67,192.52

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,647,585.60	47,301,025.62
股票投资收益——赎回差价收入	-6,298,570.67	15,679,657.75
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	-15,946,156.27	62,980,683.37

##### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	135,968,049.89	305,870,112.93
减：卖出股票成本总额	145,221,264.82	258,569,087.31
减：交易费用	394,370.67	-
买卖股票差价收入	-9,647,585.60	47,301,025.62

##### 7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	198,806,685.60	400,846,315.00
减：现金支付赎回款总额	89,051,073.60	186,106,162.00

减：赎回股票成本总额	116,054,182.67	199,060,495.25
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-6,298,570.67	15,679,657.75

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.18.2 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-1,171,609.08	998,517.47

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,946,840.53	4,109,123.51
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	3,946,840.53	4,109,123.51

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-25,733,157.28	-42,299,270.23
股票投资	-25,733,157.28	-42,299,270.23
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	-320,840.00	236,760.00
权证投资	-	-
期货投资	-320,840.00	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	-26,053,997.28	-42,062,510.23

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	197,256.04	407,459.22
合计	197,256.04	407,459.22

## 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	528.00	732.00
指数使用费	99,663.34	141,718.04
其他	150,000.00	150,000.00
交易费用	-	841,194.49
合计	420,191.34	1,303,644.53

#### 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”)	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人的股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司的子公司
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(2022 年 6 月 28 日前)

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。

银华 MSCI 中国 A 股 ETF 发起式联接自 2022 年 6 月 17 日起进入基金财产清算程序，于 2022 年 6 月 28 日结束清算。

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	996,634.17	1,431,209.71
其中：支付销售机构的客户维护费	17,709.68	23,270.07



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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	199,326.87	286,242.03

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固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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	6,501,549.75	23,055.70	9,607,496.09	41,196.32

#### 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）285,844.00 股，期末公允价值为人民币 1,240,562.96 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.69%。

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）19,133.00 股，期末公允价值为人民币 107,718.79 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.06%。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2022 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	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
301165	锐捷网络	2022年 11月14 日	6个月	新股流 通受限	32.38	31.61	220	7,123.60	6,954.20	-
301176	逸豪新材	2022年 9月21	6个月	新股流 通受限	23.88	16.89	297	7,092.36	5,016.33	-

		日									
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	367	9,644.76	6,653.71		-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	218	8,338.50	6,428.82		-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	40.00	48.32	198	7,920.00	9,567.36		-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	396	5,258.88	4,514.40		-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	146	7,428.48	9,665.20		-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	236	6,372.00	6,084.08		-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	140	9,436.00	6,272.00		-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	180	7,936.20	6,323.40		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	1,502	7,510.00	11,310.06		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	189	4,772.25	5,507.46		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	82	3,915.50	4,368.14		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	160	10,080.00	6,932.80		-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智	2022年	6个月	新股流	26.44	20.96	368	9,729.92	7,713.28		-

	科技	11月8日		通受限							
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	211	6,469.26	7,986.35		-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	227	7,881.44	5,418.49		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	123	8,038.05	5,546.07		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	63	7,552.44	11,074.14		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	285	6,364.05	5,278.20		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	323	7,390.24	5,694.49		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	75	7,200.00	6,072.75		-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股流通受限	40.13	31.90	243	9,751.59	7,751.70		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	209	7,189.60	6,048.46		-
688506	百利天恒	2022年12月28日	1个月内(含)	新股流通受限	24.70	24.70	4,463	110,236.10	110,236.10		-

注：1. 截至本报告期末 2022 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《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。

3. 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	2023年1月10日	51.05	2,627	131,827.79	121,919.07	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	1,496	155,250.47	79,706.88	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

### 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 2022 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	6,501,549.75	-	-	-	6,501,549.75
结算备付金	2,155,186.75	-	-	-	2,155,186.75
存出保证金	412,849.69	-	-	-	412,849.69
交易性金融资产	-	-	-	-170,772,068.97	170,772,068.97
资产总计	9,069,586.19	-	-	-170,772,068.97	179,841,655.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	78,359.11	78,359.11
应付托管费	-	-	-	15,671.85	15,671.85
应付清算款	-	-	-	136,601.35	136,601.35
其他负债	-	-	-	394,653.66	394,653.66
负债总计	-	-	-	625,285.97	625,285.97
利率敏感度缺口	9,069,586.19	-	-	-170,146,783.00	179,216,369.19
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	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
应收证券清算款	-	-	-	2,290,804.72	2,290,804.72
其他资产	-	-	-	3,309.99	3,309.99
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
应交税费	-	-	-	7,700.14	7,700.14
其他负债	-	-	-	333,133.58	333,133.58
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

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。

## 7.4.13.4.1.2 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净资产无重大影响。

#### 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 2022年12月31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	170,772,068.97	95.29	209,181,142.46	93.29
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	170,772,068.97	95.29	209,181,142.46	93.29

##### 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）	



分析	业绩比较基准上升 5%	8,677,982.95	10,874,154.96
	业绩比较基准下降 5%	-8,677,982.95	-10,874,154.96

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	170,284,356.95	208,371,997.20
第二层次	311,862.05	5,504.49
第三层次	175,849.97	803,640.77
合计	170,772,068.97	209,181,142.46

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	803,640.77	803,640.77
当期购买	-	189,959.04	189,959.04
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	703,561.17	703,561.17
当期利得或损失总额	-	-114,188.67	-114,188.67
其中：计入损益的利得或损失	-	-114,188.67	-114,188.67
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	175,849.97	175,849.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-14,109.07	-14,109.07
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,603,096.75	4,603,096.75
当期购买	-	331,036.30	331,036.30
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,989,109.98	3,989,109.98
当期利得或损失总额	-	-141,382.30	-141,382.30
其中：计入损益的利得或损失	-	-141,382.30	-141,382.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	803,640.77	803,640.77
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	472,604.47	472,604.47

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	175,849.97	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2783-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	803,640.77	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3138-2.7417	负相关

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

#### 7.4.16 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 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	170,772,068.97	94.96
	其中：股票	170,772,068.97	94.96
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	8,656,736.50	4.81
8	其他各项资产	412,849.69	0.23
9	合计	179,841,655.16	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	2,099,173.57	1.17
B	采矿业	6,777,451.83	3.78
C	制造业	99,394,297.34	55.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,399,080.27	3.01
E	建筑业	3,223,847.87	1.80
F	批发和零售业	1,635,730.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	5,163,579.52	2.88
H	住宿和餐饮业	367,407.15	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,949,073.97	3.32
J	金融业	30,615,589.00	17.08
K	房地产业	2,941,064.56	1.64
L	租赁和商务服务业	2,493,774.89	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,744,636.38	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	315,181.30	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,495,260.26	0.83
R	文化、体育和娱乐业	541,908.68	0.30
S	综合	260,203.75	0.15
	合计	170,417,260.34	95.09

### 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	-	-
C	制造业	311,757.54	0.17
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	18,400.04	0.01
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	14,985.85	0.01
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	9,665.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	354,808.63	0.20

### 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	5,720	9,878,440.00	5.51
2	300750	宁德时代	11,072	4,355,946.24	2.43
3	600036	招商银行	93,778	3,494,168.28	1.95
4	000858	五粮液	17,619	3,183,577.11	1.78
5	601318	中国平安	49,274	2,315,878.00	1.29
6	600900	长江电力	103,296	2,169,216.00	1.21
7	002594	比亚迪	8,196	2,106,126.12	1.18
8	601888	中国中免	8,911	1,925,043.33	1.07
9	300760	迈瑞医疗	5,547	1,752,685.59	0.98
10	601166	兴业银行	94,418	1,660,812.62	0.93
11	600809	山西汾酒	5,568	1,586,824.32	0.89
12	000568	泸州老窖	6,590	1,478,005.20	0.82

13	601012	隆基绿能	34,436	1,455,265.36	0.81
14	603288	海天味业	17,530	1,395,388.00	0.78
15	600309	万华化学	14,247	1,319,984.55	0.74
16	002352	顺丰控股	22,289	1,287,412.64	0.72
17	601398	工商银行	285,844	1,240,562.96	0.69
18	002714	牧原股份	24,088	1,174,290.00	0.66
19	300059	东方财富	59,977	1,163,553.80	0.65
20	000001	平安银行	88,184	1,160,501.44	0.65
21	601288	农业银行	386,848	1,125,727.68	0.63
22	600276	恒瑞医药	28,933	1,114,788.49	0.62
23	600030	中信证券	55,606	1,107,115.46	0.62
24	002304	洋河股份	6,846	1,098,783.00	0.61
25	601668	中国建筑	190,568	1,034,784.24	0.58
26	002475	立讯精密	32,243	1,023,715.25	0.57
27	300015	爱尔眼科	31,975	993,463.25	0.55
28	002142	宁波银行	30,046	974,992.70	0.54
29	600000	浦发银行	133,449	971,508.72	0.54
30	603259	药明康德	11,607	940,167.00	0.52
31	601899	紫金矿业	93,616	936,160.00	0.52
32	600887	伊利股份	29,026	899,806.00	0.50
33	601328	交通银行	178,304	845,160.96	0.47
34	300124	汇川技术	11,927	828,926.50	0.46
35	601088	中国神华	29,992	828,379.04	0.46
36	600048	保利发展	54,391	822,935.83	0.46
37	601225	陕西煤业	44,057	818,579.06	0.46
38	300014	亿纬锂能	9,274	815,184.60	0.45
39	000002	万科 A	44,186	804,185.20	0.45
40	600438	通威股份	20,453	789,076.74	0.44
41	600436	片仔癀	2,661	767,592.06	0.43
42	601601	中国太保	31,091	762,351.32	0.43
43	300274	阳光电源	6,750	754,650.00	0.42
44	600406	国电南瑞	30,425	742,370.00	0.41
45	600905	三峡能源	130,022	734,624.30	0.41
46	600690	海尔智家	28,637	700,461.02	0.39
47	002459	晶澳科技	10,782	647,890.38	0.36
48	300122	智飞生物	7,256	637,294.48	0.36
49	600028	中国石化	144,741	631,070.76	0.35
50	600050	中国联通	140,691	630,295.68	0.35
51	688599	天合光能	9,791	624,274.16	0.35
52	600031	三一重工	38,557	609,200.60	0.34
53	601919	中远海控	57,931	596,109.99	0.33
54	300498	温氏股份	29,758	584,149.54	0.33
55	601818	光大银行	187,911	576,886.77	0.32

56	000725	京东方 A	170,425	576,036.50	0.32
57	688111	金山办公	2,152	569,182.48	0.32
58	002493	荣盛石化	46,056	566,488.80	0.32
59	600019	宝钢股份	101,175	565,568.25	0.32
60	601766	中国中车	110,590	565,114.90	0.32
61	601658	邮储银行	120,883	558,479.46	0.31
62	000792	盐湖股份	24,600	558,174.00	0.31
63	600016	民生银行	161,056	555,643.20	0.31
64	002129	TCL 中环	14,753	555,597.98	0.31
65	002371	北方华创	2,427	546,803.10	0.31
66	300896	爱美客	964	545,961.40	0.30
67	002812	恩捷股份	4,036	529,886.44	0.30
68	002466	天齐锂业	6,700	529,233.00	0.30
69	601390	中国中铁	93,332	518,925.92	0.29
70	000596	古井贡酒	1,931	515,383.90	0.29
71	601985	中国核电	85,738	514,428.00	0.29
72	600893	航发动力	12,056	509,727.68	0.28
73	600104	上汽集团	35,351	509,407.91	0.28
74	002049	紫光国微	3,847	507,111.54	0.28
75	601988	中国银行	159,620	504,399.20	0.28
76	002460	赣锋锂业	7,196	500,193.96	0.28
77	600585	海螺水泥	18,140	496,673.20	0.28
78	600919	江苏银行	67,154	489,552.66	0.27
79	601857	中国石油	98,114	487,626.58	0.27
80	601009	南京银行	46,783	487,478.86	0.27
81	601669	中国电建	68,772	486,905.76	0.27
82	601628	中国人寿	12,645	469,382.40	0.26
83	000063	中兴通讯	18,146	469,255.56	0.26
84	601066	中信建投	19,698	467,827.50	0.26
85	002311	海大集团	7,526	464,579.98	0.26
86	601211	国泰君安	34,103	463,459.77	0.26
87	000625	长安汽车	37,617	463,065.27	0.26
88	600150	中国船舶	20,324	452,818.72	0.25
89	601006	大秦铁路	67,608	451,621.44	0.25
90	600999	招商证券	33,733	448,648.90	0.25
91	000538	云南白药	8,122	441,511.92	0.25
92	001979	招商蛇口	34,743	438,804.09	0.24
93	002027	分众传媒	65,593	438,161.24	0.24
94	601688	华泰证券	33,406	425,592.44	0.24
95	603501	韦尔股份	5,421	417,904.89	0.23
96	000776	广发证券	26,905	416,758.45	0.23
97	000651	格力电器	12,818	414,277.76	0.23
98	600346	恒力石化	26,670	414,185.10	0.23

99	601169	北京银行	96,074	414,078.94	0.23
100	601138	工业富联	45,105	414,063.90	0.23
101	600111	北方稀土	16,523	413,901.15	0.23
102	000166	申万宏源	102,388	407,504.24	0.23
103	000895	双汇发展	15,680	406,582.40	0.23
104	603806	福斯特	6,039	401,231.16	0.22
105	603799	华友钴业	7,202	400,647.26	0.22
106	600010	包钢股份	207,139	397,706.88	0.22
107	600029	南方航空	50,977	387,425.20	0.22
108	600188	兖矿能源	11,504	386,304.32	0.22
109	002709	天赐材料	8,790	385,529.40	0.22
110	601229	上海银行	64,571	381,614.61	0.21
111	600837	海通证券	43,839	380,960.91	0.21
112	300316	晶盛机电	5,949	378,118.44	0.21
113	600588	用友网络	15,555	375,964.35	0.21
114	601100	恒立液压	5,929	374,416.35	0.21
115	000963	华东医药	7,917	370,515.60	0.21
116	603993	洛阳钼业	80,310	365,410.50	0.20
117	600926	杭州银行	26,954	352,558.32	0.20
118	600570	恒生电子	8,680	351,192.80	0.20
119	002230	科大讯飞	10,644	349,442.52	0.19
120	600600	青岛啤酒	3,228	347,010.00	0.19
121	600089	特变电工	17,241	346,199.28	0.19
122	600795	国电电力	81,059	346,121.93	0.19
123	300751	迈为股份	833	343,062.72	0.19
124	600196	复星医药	9,617	338,903.08	0.19
125	603392	万泰生物	2,664	337,528.80	0.19
126	601868	中国能建	147,317	337,355.93	0.19
127	002180	纳思达	6,476	336,039.64	0.19
128	600989	宝丰能源	27,751	334,954.57	0.19
129	603659	璞泰来	6,382	331,161.98	0.18
130	601633	长城汽车	11,129	329,640.98	0.18
131	600009	上海机场	5,649	326,003.79	0.18
132	688008	澜起科技	5,121	320,574.60	0.18
133	600660	福耀玻璃	9,134	320,329.38	0.18
134	600426	华鲁恒升	9,661	320,262.15	0.18
135	601111	中国国航	30,190	320,014.00	0.18
136	300763	锦浪科技	1,773	319,228.65	0.18
137	000661	长春高新	1,914	318,585.30	0.18
138	600011	华能国际	41,718	317,473.98	0.18
139	600547	山东黄金	16,440	314,990.40	0.18
140	000338	潍柴动力	30,817	313,717.06	0.18
141	600233	圆通速递	15,552	312,439.68	0.17



142	605117	德业股份	943	312,321.60	0.17
143	603986	兆易创新	3,044	311,918.68	0.17
144	688036	传音控股	3,831	304,641.12	0.17
145	300759	康龙化成	4,466	303,688.00	0.17
146	600958	东方证券	33,942	303,441.48	0.17
147	600015	华夏银行	58,312	302,639.28	0.17
148	600745	闻泰科技	5,678	298,549.24	0.17
149	601689	拓普集团	5,060	296,414.80	0.17
150	600845	宝信软件	6,598	295,590.40	0.16
151	300661	圣邦股份	1,699	293,247.40	0.16
152	300142	沃森生物	7,256	291,618.64	0.16
153	603369	今世缘	5,713	290,791.70	0.16
154	300999	金龙鱼	6,623	288,497.88	0.16
155	600115	中国东航	51,873	286,857.69	0.16
156	601336	新华保险	9,532	286,722.56	0.16
157	600132	重庆啤酒	2,250	286,605.00	0.16
158	603833	欧派家居	2,350	285,595.50	0.16
159	600085	同仁堂	6,300	281,484.00	0.16
160	688012	中微公司	2,810	275,408.10	0.15
161	000733	振华科技	2,394	273,466.62	0.15
162	000425	徐工机械	53,748	272,502.36	0.15
163	603290	斯达半导	823	271,013.90	0.15
164	601877	正泰电器	9,751	270,102.70	0.15
165	300782	卓胜微	2,361	269,862.30	0.15
166	600256	广汇能源	29,856	269,301.12	0.15
167	300408	三环集团	8,752	268,773.92	0.15
168	601600	中国铝业	59,884	267,681.48	0.15
169	600875	东方电气	12,608	265,020.16	0.15
170	000876	新希望	20,468	264,241.88	0.15
171	601788	光大证券	17,729	263,630.23	0.15
172	002001	新和成	14,045	263,343.75	0.15
173	600039	四川路桥	23,591	262,331.92	0.15
174	688396	华润微	4,969	261,617.85	0.15
175	002241	歌尔股份	15,467	260,309.61	0.15
176	002736	国信证券	29,062	258,070.56	0.14
177	601618	中国中冶	81,143	258,034.74	0.14
178	002920	德赛西威	2,449	257,977.66	0.14
179	601825	沪农商行	43,800	257,544.00	0.14
180	601865	福莱特	7,684	255,954.04	0.14
181	000938	紫光股份	13,014	253,903.14	0.14
182	300413	芒果超媒	8,450	253,669.00	0.14
183	601838	成都银行	16,431	251,394.30	0.14
184	600522	中天科技	15,452	249,549.80	0.14

185	600176	中国巨石	18,155	248,905.05	0.14
186	600741	华域汽车	14,360	248,858.80	0.14
187	300628	亿联网络	4,079	247,146.61	0.14
188	000301	东方盛虹	18,884	246,247.36	0.14
189	601238	广汽集团	22,296	245,924.88	0.14
190	601939	建设银行	43,610	245,524.30	0.14
191	002938	鹏鼎控股	8,832	242,350.08	0.14
192	601615	明阳智能	9,578	241,940.28	0.13
193	600754	锦江酒店	4,129	240,927.15	0.13
194	300433	蓝思科技	22,634	238,336.02	0.13
195	002648	卫星化学	15,319	237,444.50	0.13
196	000100	TCL 科技	63,678	236,882.16	0.13
197	300033	同花顺	2,371	233,804.31	0.13
198	603899	晨光股份	4,188	230,256.24	0.13
199	002821	凯莱英	1,550	229,400.00	0.13
200	601699	潞安环能	13,562	228,519.70	0.13
201	002603	以岭药业	7,568	226,737.28	0.13
202	601727	上海电气	57,513	226,601.22	0.13
203	600018	上港集团	42,265	225,695.10	0.13
204	601377	兴业证券	39,281	225,472.94	0.13
205	601319	中国人保	43,010	224,512.20	0.13
206	601607	上海医药	12,591	224,497.53	0.13
207	601916	浙商银行	76,015	223,484.10	0.12
208	600763	通策医疗	1,458	223,059.42	0.12
209	688180	君实生物	3,547	222,042.20	0.12
210	688063	派能科技	700	220,955.00	0.12
211	300454	深信服	1,960	220,598.00	0.12
212	603345	安井食品	1,361	220,318.68	0.12
213	601117	中国化学	27,744	220,287.36	0.12
214	600027	华电国际	37,100	218,148.00	0.12
215	000983	山西焦煤	18,667	217,470.55	0.12
216	002074	国轩高科	7,542	217,435.86	0.12
217	600460	士兰微	6,497	213,036.63	0.12
218	601360	三六零	32,512	212,628.48	0.12
219	603606	东方电缆	3,133	212,511.39	0.12
220	601155	新城控股	10,287	210,883.50	0.12
221	300496	中科创达	2,100	210,630.00	0.12
222	600383	金地集团	20,510	209,817.30	0.12
223	603939	益丰药房	3,269	208,692.96	0.12
224	000999	华润三九	4,446	208,117.26	0.12
225	601872	招商轮船	36,900	206,271.00	0.12
226	002601	龙佰集团	10,886	205,963.12	0.11
227	688122	西部超导	2,165	205,003.85	0.11

228	603613	国联股份	2,312	204,473.28	0.11
229	603737	三棵树	1,794	204,211.02	0.11
230	600674	川投能源	16,693	204,155.39	0.11
231	601995	中金公司	5,353	204,109.89	0.11
232	688777	中控技术	2,244	203,822.52	0.11
233	000799	酒鬼酒	1,476	203,599.44	0.11
234	688363	华熙生物	1,500	202,920.00	0.11
235	000069	华侨城 A	37,272	198,659.76	0.11
236	000786	北新建材	7,651	198,007.88	0.11
237	002252	上海莱士	30,628	194,181.52	0.11
238	603185	上机数控	1,832	193,917.20	0.11
239	300957	贝泰妮	1,296	193,415.04	0.11
240	603260	合盛硅业	2,323	192,669.62	0.11
241	600332	白云山	6,463	192,532.77	0.11
242	600779	水井坊	2,268	191,464.56	0.11
243	002384	东山精密	7,741	191,434.93	0.11
244	300769	德方纳米	833	191,248.47	0.11
245	603198	迎驾贡酒	3,040	190,851.20	0.11
246	600026	中远海能	15,789	190,257.45	0.11
247	002120	韵达股份	13,202	189,844.76	0.11
248	600160	巨化股份	12,206	189,315.06	0.11
249	600803	新奥股份	11,744	189,078.40	0.11
250	300003	乐普医疗	8,159	187,412.23	0.10
251	300347	泰格医药	1,787	187,277.60	0.10
252	600153	建发股份	13,693	186,909.45	0.10
253	002007	华兰生物	8,246	186,606.98	0.10
254	600584	长电科技	8,052	185,598.60	0.10
255	002841	视源股份	3,140	185,385.60	0.10
256	000629	钒钛股份	39,041	184,663.93	0.10
257	000408	藏格矿业	7,100	184,387.00	0.10
258	603486	科沃斯	2,526	184,246.44	0.10
259	688301	奕瑞科技	400	183,152.00	0.10
260	002555	三七互娱	10,081	182,466.10	0.10
261	601881	中国银河	19,553	181,647.37	0.10
262	688390	固德威	557	179,961.13	0.10
263	600884	杉杉股份	9,876	179,743.20	0.10
264	300724	捷佳伟创	1,575	179,581.50	0.10
265	600298	安琪酵母	3,960	179,071.20	0.10
266	300832	新产业	3,563	178,648.82	0.10
267	688187	时代电气	3,271	178,498.47	0.10
268	000723	美锦能源	19,733	177,991.66	0.10
269	600219	南山铝业	54,314	177,606.78	0.10
270	002013	中航机电	17,633	177,211.65	0.10

271	002568	百润股份	4,737	176,974.32	0.10
272	300146	汤臣倍健	7,699	175,691.18	0.10
273	600079	人福医药	7,354	175,687.06	0.10
274	000157	中联重科	32,295	175,684.80	0.10
275	002756	永兴材料	1,902	175,307.34	0.10
276	600536	中国软件	3,000	174,990.00	0.10
277	601878	浙商证券	17,603	174,797.79	0.10
278	002430	杭氧股份	4,437	174,640.32	0.10
279	600096	云天化	8,300	174,632.00	0.10
280	000807	云铝股份	15,694	174,517.28	0.10
281	300699	光威复材	2,395	173,038.75	0.10
282	300144	宋城演艺	11,831	172,732.60	0.10
283	002202	金风科技	15,622	171,842.00	0.10
284	002422	科伦药业	6,437	171,288.57	0.10
285	002916	深南电路	2,372	171,139.80	0.10
286	603882	金域医学	2,172	169,850.40	0.09
287	600918	中泰证券	26,411	169,294.51	0.09
288	603233	大参林	4,275	169,290.00	0.09
289	600563	法拉电子	1,053	168,353.64	0.09
290	002294	信立泰	5,117	168,093.45	0.09
291	002385	大北农	18,864	167,889.60	0.09
292	688385	复旦微电	2,395	167,194.95	0.09
293	601799	星宇股份	1,310	166,854.70	0.09
294	002625	光启技术	9,802	166,830.04	0.09
295	603517	绝味食品	2,711	165,614.99	0.09
296	688188	柏楚电子	760	164,980.80	0.09
297	002414	高德红外	14,988	164,868.00	0.09
298	300919	中伟股份	2,510	164,681.10	0.09
299	300207	欣旺达	7,781	164,568.15	0.09
300	600362	江西铜业	9,434	164,434.62	0.09
301	300438	鹏辉能源	2,100	163,779.00	0.09
302	600487	亨通光电	10,818	162,919.08	0.09
303	002080	中材科技	7,601	162,889.43	0.09
304	300601	康泰生物	5,156	162,568.68	0.09
305	002340	格林美	21,696	161,201.28	0.09
306	603456	九洲药业	3,780	160,385.40	0.09
307	603816	顾家家居	3,747	160,034.37	0.09
308	601233	桐昆股份	11,034	159,441.30	0.09
309	300223	北京君正	2,240	157,785.60	0.09
310	603589	口子窖	2,731	157,496.77	0.09
311	600348	华阳股份	11,007	156,849.75	0.09
312	688009	中国通号	32,687	156,570.73	0.09
313	002236	大华股份	13,807	156,157.17	0.09

314	002372	伟星新材	7,222	154,117.48	0.09
315	002064	华峰化学	22,586	153,584.80	0.09
316	600183	生益科技	10,639	153,307.99	0.09
317	000738	航发控制	5,970	153,070.80	0.09
318	000933	神火股份	10,227	152,995.92	0.09
319	601216	君正集团	38,325	152,916.75	0.09
320	002791	坚朗五金	1,462	151,974.90	0.08
321	603596	伯特利	1,900	151,620.00	0.08
322	000066	中国长城	14,726	150,205.20	0.08
323	601108	财通证券	21,080	150,089.60	0.08
324	002518	科士达	2,600	149,760.00	0.08
325	601555	东吴证券	22,806	148,923.18	0.08
326	688536	思瑞浦	540	148,721.40	0.08
327	600141	兴发集团	5,108	148,132.00	0.08
328	000932	华菱钢铁	31,368	147,429.60	0.08
329	000630	铜陵有色	47,224	147,338.88	0.08
330	002240	盛新锂能	3,916	146,810.84	0.08
331	600486	扬农化工	1,413	146,810.70	0.08
332	300037	新宙邦	3,374	146,667.78	0.08
333	600521	华海药业	6,696	146,374.56	0.08
334	000831	中国稀土	4,426	145,526.88	0.08
335	002600	领益智造	31,985	145,211.90	0.08
336	300390	天华超净	2,594	144,952.72	0.08
337	300595	欧普康视	4,057	144,834.90	0.08
338	688005	容百科技	2,098	144,237.50	0.08
339	002223	鱼跃医疗	4,521	144,039.06	0.08
340	600985	淮北矿业	11,200	143,360.00	0.08
341	000977	浪潮信息	6,611	142,268.72	0.08
342	603568	伟明环保	7,672	142,162.16	0.08
343	002738	中矿资源	2,131	142,052.46	0.08
344	601077	渝农商行	40,205	141,923.65	0.08
345	000009	中国宝安	11,675	141,150.75	0.08
346	688516	奥特维	697	140,097.00	0.08
347	002078	太阳纸业	12,150	139,968.00	0.08
348	000975	银泰黄金	12,646	139,611.84	0.08
349	601058	赛轮轮胎	13,931	139,588.62	0.08
350	002831	裕同科技	4,200	138,894.00	0.08
351	002056	横店东磁	7,400	138,676.00	0.08
352	601880	辽港股份	85,600	138,672.00	0.08
353	601636	旗滨集团	12,147	138,354.33	0.08
354	000027	深圳能源	21,581	137,255.16	0.08
355	688099	晶晨股份	1,941	136,859.91	0.08
356	601966	玲珑轮胎	6,659	136,376.32	0.08

357	000729	燕京啤酒	12,800	135,936.00	0.08
358	603885	吉祥航空	8,400	135,912.00	0.08
359	002532	天山铝业	17,596	135,841.12	0.08
360	002176	江特电机	7,725	134,801.25	0.08
361	600655	豫园股份	17,657	134,369.77	0.07
362	002299	圣农发展	5,669	134,298.61	0.07
363	601696	中银证券	12,652	133,731.64	0.07
364	000783	长江证券	25,088	133,719.04	0.07
365	300357	我武生物	2,418	133,231.80	0.07
366	600177	雅戈尔	21,014	133,018.62	0.07
367	002028	思源电气	3,478	132,929.16	0.07
368	600705	中航产融	40,525	132,922.00	0.07
369	300073	当升科技	2,345	132,258.00	0.07
370	603707	健友股份	7,330	132,233.20	0.07
371	300395	菲利华	2,400	132,000.00	0.07
372	600872	中炬高新	3,576	131,847.12	0.07
373	600415	小商品城	24,918	130,570.32	0.07
374	600848	上海临港	10,939	130,392.88	0.07
375	000591	太阳能	17,736	130,004.88	0.07
376	002353	杰瑞股份	4,657	129,976.87	0.07
377	000683	远兴能源	16,473	129,148.32	0.07
378	002966	苏州银行	16,600	129,148.00	0.07
379	002602	世纪华通	33,867	129,033.27	0.07
380	002850	科达利	1,086	129,027.66	0.07
381	600021	上海电力	12,800	128,128.00	0.07
382	605358	立昂微	3,000	127,800.00	0.07
383	002939	长城证券	15,363	127,205.64	0.07
384	600258	首旅酒店	5,100	126,480.00	0.07
385	600549	厦门钨业	6,456	126,214.80	0.07
386	000519	中兵红箭	6,398	125,656.72	0.07
387	002244	滨江集团	14,200	125,386.00	0.07
388	000728	国元证券	19,745	124,985.85	0.07
389	300568	星源材质	5,876	124,923.76	0.07
390	300373	扬杰科技	2,370	124,662.00	0.07
391	002673	西部证券	20,312	123,700.08	0.07
392	601577	长沙银行	18,269	123,498.44	0.07
393	002531	天顺风能	8,149	123,294.37	0.07
394	601456	国联证券	10,937	123,041.25	0.07
395	002497	雅化集团	5,281	122,783.25	0.07
396	603127	昭衍新药	2,101	122,719.41	0.07
397	603077	和邦生物	40,130	121,995.20	0.07
398	600038	中直股份	2,627	121,919.07	0.07
399	600583	海油工程	20,081	121,690.86	0.07

400	603712	七一二	3,479	121,486.68	0.07
401	000423	东阿阿胶	2,984	121,448.80	0.07
402	002185	华天科技	14,632	121,299.28	0.07
403	600499	科达制造	8,528	121,182.88	0.07
404	300604	长川科技	2,700	120,366.00	0.07
405	002508	老板电器	4,314	119,756.64	0.07
406	000155	川能动力	6,709	119,688.56	0.07
407	002405	四维图新	10,857	119,644.14	0.07
408	600673	东阳光	13,700	119,053.00	0.07
409	002153	石基信息	7,916	118,660.84	0.07
410	002032	苏泊尔	2,378	117,615.88	0.07
411	002192	融捷股份	1,200	117,480.00	0.07
412	000703	恒逸石化	16,669	117,183.07	0.07
413	002268	电科网安	3,830	116,929.90	0.07
414	603605	珀莱雅	696	116,566.08	0.07
415	600056	中国医药	6,750	116,302.50	0.06
416	000739	普洛药业	5,391	116,122.14	0.06
417	002407	多氟多	3,479	115,920.28	0.06
418	300251	光线传媒	13,338	115,507.08	0.06
419	601666	平煤股份	10,600	114,586.00	0.06
420	000893	亚钾国际	4,200	114,156.00	0.06
421	000987	越秀资本	19,039	114,043.61	0.06
422	600704	物产中大	23,611	113,568.91	0.06
423	601198	东兴证券	14,690	113,406.80	0.06
424	301035	润丰股份	1,300	113,230.00	0.06
425	300529	健帆生物	3,652	113,102.44	0.06
426	002156	通富微电	6,861	113,069.28	0.06
427	002624	完美世界	8,856	112,648.32	0.06
428	000825	太钢不锈	26,022	112,415.04	0.06
429	002409	雅克科技	2,216	111,619.92	0.06
430	600566	济川药业	4,100	111,602.00	0.06
431	600998	九州通	8,557	111,583.28	0.06
432	002152	广电运通	11,220	111,526.80	0.06
433	601168	西部矿业	10,900	111,180.00	0.06
434	603338	浙江鼎力	2,321	111,059.85	0.06
435	600392	盛和资源	7,930	111,020.00	0.06
436	600598	北大荒	8,021	110,368.96	0.06
437	603267	鸿远电子	1,084	109,657.44	0.06
438	601866	中远海发	45,059	109,042.78	0.06
439	000709	河钢股份	48,230	108,999.80	0.06
440	002044	美年健康	17,763	108,887.19	0.06
441	000800	一汽解放	14,084	108,869.32	0.06
442	002128	电投能源	8,775	108,283.50	0.06

443	000830	鲁西化工	8,698	107,768.22	0.06
444	002797	第一创业	19,133	107,718.79	0.06
445	000960	锡业股份	7,560	106,596.00	0.06
446	603858	步长制药	5,050	106,100.50	0.06
447	600516	方大炭素	17,285	105,784.20	0.06
448	300034	钢研高纳	2,300	105,432.00	0.06
449	600170	上海建工	40,470	105,222.00	0.06
450	601991	大唐发电	37,500	104,625.00	0.06
451	002507	涪陵榨菜	4,015	103,466.55	0.06
452	002487	大金重工	2,500	103,425.00	0.06
453	600688	上海石化	33,215	103,298.65	0.06
454	002463	沪电股份	8,620	102,578.00	0.06
455	000937	冀中能源	15,984	101,658.24	0.06
456	300676	华大基因	1,953	100,950.57	0.06
457	300776	帝尔激光	800	100,800.00	0.06
458	002030	达安基因	6,444	100,268.64	0.06
459	000401	冀东水泥	12,023	98,949.29	0.06
460	300363	博腾股份	2,400	98,040.00	0.05
461	300308	中际旭创	3,627	98,037.81	0.05
462	300558	贝达药业	1,959	96,519.93	0.05
463	000050	深天马 A	11,139	96,463.74	0.05
464	601992	金隅集团	37,891	96,243.14	0.05
465	000998	隆平高科	5,978	96,066.46	0.05
466	002138	顺络电子	3,656	95,714.08	0.05
467	002266	浙富控股	24,382	95,333.62	0.05
468	600380	健康元	8,424	95,106.96	0.05
469	603444	吉比特	304	95,103.36	0.05
470	600338	西藏珠峰	4,130	94,659.60	0.05
471	603866	桃李面包	6,096	93,878.40	0.05
472	600801	华新水泥	6,275	92,995.50	0.05
473	002541	鸿路钢构	3,143	92,058.47	0.05
474	002408	齐翔腾达	12,937	91,076.48	0.05
475	688202	美迪西	420	89,833.80	0.05
476	000513	丽珠集团	2,757	89,547.36	0.05
477	002926	华西证券	11,877	89,433.81	0.05
478	600699	均胜电子	6,294	88,430.70	0.05
479	603218	日月股份	4,349	88,284.70	0.05
480	002092	中泰化学	11,809	88,095.14	0.05
481	002326	永太科技	3,966	86,577.78	0.05
482	002500	山西证券	16,332	86,559.60	0.05
483	601016	节能风电	22,607	86,132.67	0.05
484	300726	宏达电子	1,944	85,808.16	0.05
485	002465	海格通信	10,549	85,657.88	0.05



486	600711	盛屯矿业	14,309	84,280.01	0.05
487	688006	杭可科技	1,907	83,469.39	0.05
488	002145	中核钛白	13,533	83,363.28	0.05
489	002065	东华软件	14,637	82,845.42	0.05
490	000750	国海证券	24,711	82,287.63	0.05
491	600295	鄂尔多斯	5,380	81,722.20	0.05
492	600885	宏发股份	2,398	80,117.18	0.04
493	300850	新强联	1,496	79,706.88	0.04
494	300070	碧水源	16,424	77,685.52	0.04
495	688002	睿创微纳	2,085	77,541.15	0.04
496	002506	协鑫集成	26,601	77,408.91	0.04
497	000988	华工科技	4,534	74,402.94	0.04
498	002456	欧菲光	14,868	70,028.28	0.04
499	002557	洽洽食品	1,218	60,900.00	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	688506	百利天恒	4,463	110,236.10	0.06
2	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
3	301301	川宁生物	1,502	11,310.06	0.01
4	301367	怡和嘉业	63	11,074.14	0.01
5	301267	华夏眼科	146	9,665.20	0.01
6	301230	泓博医药	198	9,567.36	0.01
7	301363	美好医疗	211	7,986.35	0.00
8	301396	宏景科技	243	7,751.70	0.00
9	301361	众智科技	368	7,713.28	0.00
10	301165	锐捷网络	220	6,954.20	0.00
11	301356	天振股份	160	6,932.80	0.00
12	301223	中荣股份	367	6,653.71	0.00
13	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
14	301227	森鹰窗业	218	6,428.82	0.00
15	301290	东星医疗	180	6,323.40	0.00
16	301280	珠城科技	140	6,272.00	0.00
17	301277	新天地	236	6,084.08	0.00
18	301391	卡莱特	75	6,072.75	0.00
19	301398	星源卓镁	209	6,048.46	0.00
20	301377	鼎泰高科	323	5,694.49	0.00
21	301366	一博科技	123	5,546.07	0.00
22	301313	凡拓数创	189	5,507.46	0.00
23	301365	矩阵股份	227	5,418.49	0.00
24	301368	丰立智能	285	5,278.20	0.00
25	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
26	301176	逸豪新材	297	5,016.33	0.00

27	301265	华新环保	396	4,514.40	0.00
28	301319	唯特偶	82	4,368.14	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	5,360,013.00	2.39
2	000858	五粮液	3,697,471.00	1.65
3	002594	比亚迪	2,926,675.00	1.31
4	000568	泸州老窖	2,341,389.00	1.04
5	300760	迈瑞医疗	1,764,671.00	0.79
6	002304	洋河股份	1,734,913.00	0.77
7	300059	东方财富	1,677,238.00	0.75
8	002714	牧原股份	1,654,664.00	0.74
9	000001	平安银行	1,535,173.00	0.68
10	002352	顺丰控股	1,441,435.65	0.64
11	600519	贵州茅台	1,402,655.00	0.63
12	002475	立讯精密	1,373,070.00	0.61
13	002142	宁波银行	1,359,932.00	0.61
14	300274	阳光电源	1,175,466.00	0.52
15	002812	恩捷股份	1,146,648.00	0.51
16	300015	爱尔眼科	1,115,801.11	0.50
17	300122	智飞生物	1,107,708.00	0.49
18	002466	天齐锂业	1,065,445.00	0.48
19	002049	紫光国微	1,060,583.00	0.47
20	600000	浦发银行	1,038,253.00	0.46

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	4,938,523.50	2.20
2	000858	五粮液	3,432,151.96	1.53
3	002594	比亚迪	2,779,100.42	1.24
4	000568	泸州老窖	2,171,246.32	0.97
5	300760	迈瑞医疗	1,614,596.78	0.72
6	002304	洋河股份	1,612,883.26	0.72
7	002714	牧原股份	1,527,457.10	0.68
8	300059	东方财富	1,480,227.46	0.66
9	000001	平安银行	1,415,923.67	0.63
10	002352	顺丰控股	1,324,288.46	0.59

11	002475	立讯精密	1,264,875.54	0.56
12	002142	宁波银行	1,170,662.58	0.52
13	300274	阳光电源	1,094,891.76	0.49
14	002812	恩捷股份	1,083,141.17	0.48
15	300122	智飞生物	1,058,784.74	0.47
16	300015	爱尔眼科	1,029,459.15	0.46
17	002049	紫光国微	999,103.45	0.45
18	300124	汇川技术	954,658.83	0.43
19	601816	京沪高铁	949,658.82	0.42
20	600872	中炬高新	904,055.65	0.40

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	142,448,523.24
卖出股票收入（成交）总额	135,968,049.89

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 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

本基金本报告期末投资国债期货。

## 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	412,849.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
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	412,849.69

### 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

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	688506	百利天恒	110,236.10	0.06	新股流通受限
2	301301	川宁生物	11,310.06	0.01	新股流通受限
3	301367	怡和嘉业	11,074.14	0.01	新股流通受限
4	301267	华夏眼科	9,665.20	0.01	新股流通受限

### 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

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 (%)
1,691	82,084.91	91,640,059.00	66.02	47,165,523.00	33.98

### 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司	46,440,000.00	33.46
2	永安国富资产管理有限公司—永安国富—稳健6号私募基金	12,370,600.00	8.91
3	中信建投证券股份有限公司	5,110,587.00	3.68
4	永安国富资产管理有限公司—永安国富—稳健8号私募基金	5,093,300.00	3.67
5	方正证券股份有限公司	4,991,500.00	3.60
6	永安国富资产管理有限公司—永安国富—稳健5号私募投资基金	4,785,900.00	3.45
7	招商证券股份有限公司	3,701,100.00	2.67
8	华泰证券股份有限公司	3,690,000.00	2.66
9	广发证券股份有限公司	2,773,399.00	2.00
10	陈燕	2,000,000.00	1.44

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	141,805,582.00
本报告期基金总申购份额	144,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	147,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,805,582.00

## § 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

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。

2022年8月30日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，公司总经理王立新先生自2022年8月28日起代任本基金管理人首席信息官职务。张轶先生自2022年8月28日起不再担任本基金管理人首席信息官职务。

2022年10月14日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，郑蓓雷女士自2022年10月13日起担任本基金管理人财务负责人职务，王勇先生自2022年10月13日起担任本基金管理人董事会秘书职务。

#### 11.2.2 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。

### 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

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

## 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。该审计机构连续四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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	银华基金管理股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 11 月 24 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函（行政监管措施）
受到稽查或处罚等措施的原因	公司在内控管理、销售业务管理中，违反了《证券投资基金管理公司管理办法》（证监会令第 22 号）第四十五条、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第 175 号）第三十条第一项规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。公司所有业务均正常开展。
其他	无。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金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	145,321,976.70	53.25	106,274.70	47.66	-
中泰证券	4	51,781,153.61	18.97	48,223.55	21.63	-
兴业证券	1	24,665,214.42	9.04	22,971.42	10.30	-

英大证券	2	22,246,080.01	8.15	20,718.40	9.29	新增 1个 交易 单元
东方财富	7	10,448,253.50	3.83	9,730.41	4.36	新增 2个 交易 单元
国盛证券	2	9,695,642.92	3.55	7,090.06	3.18	-
国泰君安	1	4,163,000.07	1.53	3,876.84	1.74	-
信达证券	1	3,724,431.95	1.36	3,468.38	1.56	-
东吴证券	2	699,857.75	0.26	511.83	0.23	-
开源证券	2	179,902.62	0.07	131.56	0.06	新增 2个 交易 单元
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	0	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
华西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-



中信证券	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。

### 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	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
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 MSCI 中国 A 股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 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 1 月 21 日
3	《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 2 月 28 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于增加广发证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构、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 3 月 18 日
5	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 29 日
6	《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 3 月 29 日
7	《银华 MSCI 中国 A 股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 4 月 20 日
8	《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 4 月 20 日
9	《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 6 月 20 日
10	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022 年 7 月 19 日
11	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 7 月 19 日
12	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022 年 8 月 29 日
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 8 月 29 日
14	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022 年 10 月 25 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部	四大证券报	2022 年 10 月 25 日

	分基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告》		
16	《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	2022 年 12 月 23 日
17	《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 (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 12 月 23 日

## § 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	20220101-20221231	46,440,000.00	0.00	0.00	46,440,000.00	33.46
	2	20220317-20220320	24,188,200.00	21,496,300.00	45,684,500.00	0.00	0.00
	2	20220211-20220309	24,188,200.00	21,496,300.00	45,684,500.00	0.00	0.00

#### 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

无。

## § 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 本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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2023年3月31日