

银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证
券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 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 2025 年 08 月 27 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 2025 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58

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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 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	402,793,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易场所	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	本基金主要采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。 建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	银华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张姗
	联系电话	(010) 58163000	400-61-95555
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	400-61-95555
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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,501,790.30
本期利润	36,009,459.32
加权平均基金份额本期利润	0.0823
本期加权平均净值利润率	9.72%
本期基金份额净值增长率	9.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-95,206,156.18
期末可供分配基金份额利润	-0.2364
期末基金资产净值	358,100,683.09
期末基金份额净值	0.8890
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-11.10%

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。

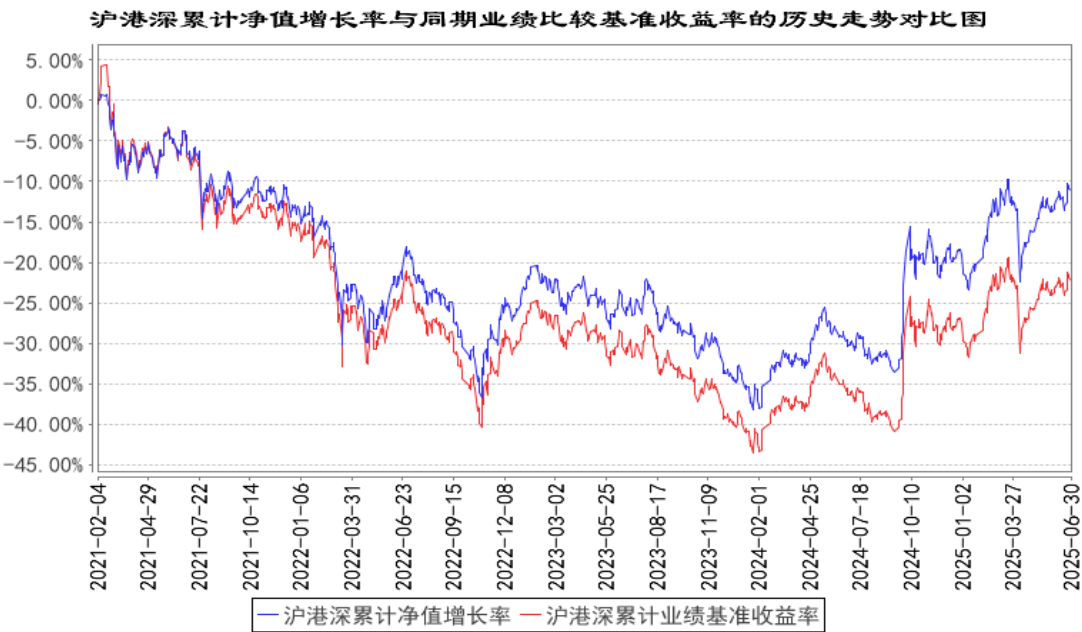
3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	3.12%	0.71%	2.55%	0.73%	0.57%	-0.02%
过去三个月	2.95%	1.45%	1.37%	1.53%	1.58%	-0.08%
过去六个月	9.83%	1.29%	7.45%	1.35%	2.38%	-0.06%
过去一年	27.33%	1.31%	22.19%	1.36%	5.14%	-0.05%
过去三年	9.15%	1.11%	-0.49%	1.14%	9.64%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-11.10%	1.14%	-22.16%	1.19%	11.06%	-0.05%

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



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

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2025 年上半年，银华基金管理公募基金 227 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续五年实现运营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

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		
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	—	12.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资

				基金基金经理,自2020年5月28日至2023年4月12日兼任银华中证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日至2023年4月6日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日至2023年7月28日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日至2024年1月23日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日至2023年3月17日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日至2024年1月23日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,自2022年9月1日起兼任银华沪深300成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2022年11月24日至2024
--	--	--	--	---

					年 1 月 23 日兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 12 月 29 日至 2024 年 1 月 23 日兼任银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 6 月 26 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 25 日起兼任银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2024 年 3 月 6 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 5 月 22 日起兼任银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 1 月 17 日起兼任银华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 17 日至 2025 年 2 月 4 日兼任银华上证 180 指数型发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 5 日起兼任银华上证 180 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 2025 年 4 月 9 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 7 月 8 日起兼任银华国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
李宜璇女士	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	2025 年 5 月 29 日	11 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，现任量化投资部总监助理/基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式

					证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日至 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 日至 2025 年 5 月 29 日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 日至 2025 年 3 月 12 日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，自 2024 年 6 月 13 日起兼任银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 23 日起兼任银华中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 4 月 25 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发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理	2021 年 4 月 19 日	-	11 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。

	助理				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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

2025 年上半年，国内外宏观经济运行呈现出一些新的特点。国内方面，整体经济格局依然延续弱复苏的态势。在消费品国补等政策支撑下，内需消费稳健。此外，上半年经济中出现了一些新的亮点，如 AI、传媒、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品。海外方面，关税战给全球

贸易带来了明显的不确定性，全球风险偏好在上半年出现了较大幅度的波动，避险情绪上升。在上述因素的作用下，上半年 A 股和港股市场呈现波动后修复的特征，上证指数、中证 500、创业板指、恒生指数等宽基指数获得正收益。

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 0.8890 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.83%，业绩比较基准收益率为 7.45%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 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 2025 年下半年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，国内政策、全球关税冲突、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

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

本基金于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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	18,501,614.35	21,956,340.51
结算备付金		5,604.48	27,763.45
存出保证金		15,214.70	8,004.22
交易性金融资产	6.4.7.2	340,625,634.57	373,592,303.21
其中：股票投资		340,625,634.57	373,592,303.21
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		745,522.09	1,560,283.11
应收股利		857,749.92	43,344.18
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		360,751,340.11	397,188,038.68
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		2,384,270.40	1,970,627.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		149,759.21	171,340.33
应付托管费		29,951.84	34,268.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,675.57	176,120.28
负债合计		2,650,657.02	2,352,356.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	402,793,000.00	487,793,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-44,692,316.91	-92,957,317.51
净资产合计		358,100,683.09	394,835,682.49
负债和净资产总计		360,751,340.11	397,188,038.68

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8890 元，基金份额总额 402,793,000.00 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		37,200,402.55	16,527,172.10
1. 利息收入		37,903.24	34,207.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,903.24	34,207.08
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,097,463.30	-18,674,479.00
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,288,134.77	-24,010,126.74
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,190,671.47	5,335,647.74
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	39,511,249.62	35,295,587.41
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	-251,287.01	-128,143.39
减：二、营业总支出		1,190,943.23	1,307,333.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	919,573.15	996,667.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	183,914.61	199,333.58
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	87, 455. 47	111, 332. 95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36, 009, 459. 32	15, 219, 838. 22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36, 009, 459. 32	15, 219, 838. 22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36, 009, 459. 32	15, 219, 838. 22

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	487, 793, 000. 00	-	-92, 957, 317. 51	394, 835, 682. 49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	487, 793, 000. 00	-	-92, 957, 317. 51	394, 835, 682. 49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-85, 000, 000. 00	-	48, 265, 000. 60	-36, 734, 999. 40
（一）、综合收益总额	-	-	36, 009, 459. 32	36, 009, 459. 32
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-85, 000, 000. 00	-	12, 255, 541. 28	-72, 744, 458. 72
其中：1. 基金申购款	10, 000, 000. 00	-	-1, 336, 517. 55	8, 663, 482. 45
2. 基金赎回	-95, 000, 000. 00	-	13, 592, 058. 83	-81, 407, 941. 17

回款				
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	402,793,000.00	-	-44,692,316.91	358,100,683.09
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	617,793,000.00	-	-201,902,424.46	415,890,575.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	617,793,000.00	-	-201,902,424.46	415,890,575.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,000,000.00	-	33,583,723.69	-26,416,276.31
（一）、综合收益总额	-	-	15,219,838.22	15,219,838.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-60,000,000.00	-	18,363,885.47	-41,636,114.53
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	-2,884,641.87	7,115,358.13
2. 基金赎回款	-70,000,000.00	-	21,248,527.34	-48,751,472.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	557,793,000.00	-	-168,318,700.77	389,474,299.23

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,未发生利息折份额的情况。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)、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。本基金可以根据相关法律法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、本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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根

据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	18,501,614.35
等于：本金	18,499,582.59
加：应计利息	2,031.76
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	18,501,614.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		361,736,819.42	-	340,625,634.57	-21,111,184.85
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	361,736,819.42	-	340,625,634.57	-21,111,184.85

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2025 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	7,332.41
其中：交易所市场	7,332.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	86,675.57

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	487,793,000.00	487,793,000.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-95,000,000.00	-95,000,000.00
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	402,793,000.00	402,793,000.00

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
上年度末	-111,593,741.22	18,636,423.71	-92,957,317.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-111,593,741.22	18,636,423.71	-92,957,317.51
本期利润	-3,501,790.30	39,511,249.62	36,009,459.32
本期基金份额交易产生的变动数	19,889,375.34	-7,633,834.06	12,255,541.28
其中：基金申购款	-2,370,979.83	1,034,462.28	-1,336,517.55
基金赎回款	22,260,355.17	-8,668,296.34	13,592,058.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-95,206,156.18	50,513,839.27	-44,692,316.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,288.65
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	588.91
其他	25.68
合计	37,903.24

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,664,512.81
股票投资收益——赎回差价收入	-2,623,621.96
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	-7,288,134.77

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	67,614,954.32
减：卖出股票成本总额	72,183,125.90
减：交易费用	96,341.23
买卖股票差价收入	-4,664,512.81

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 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

赎回基金份额对价总额	81,407,941.17
减：现金支付赎回款总额	54,009,548.17
减：赎回股票成本总额	30,022,014.96
减：交易费用	—
赎回差价收入	-2,623,621.96

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 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

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

注：无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,190,671.47
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	5,190,671.47

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	39,511,249.62
股票投资	39,511,249.62
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	39,511,249.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	-251,287.01
合计	-251,287.01

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,720.30
其他	6,392.01
合计	87,455.47

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

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（“银华基金”）	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：下述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

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	919,573.15	996,667.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,069.48	15,566.09
应支付基金管理人的净管理费	856,503.67	981,101.26

注：支付基金管理人银华基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	183,914.61	199,333.58

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	18,501,614.35	37,288.65	19,488,189.14	32,537.43

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）100,000.00 股，期末公允价值为人民币 4,595,000.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.28%；招商银行（代码 3968）37,500.00 股，期末公允价值为人民币 1,875,767.16 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.52%。

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）28,600.00 股，期末公允价值为人民币 254,254.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.07%。

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：上汽集团（600104）37,400.00 股，期末公允价值为人民币 600,270.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.17%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉	2025	6 个月	新股	27.50	56.19	332	9,130.00	18,655.08	-

	朔科技	年3月4日		流通受限						
301458	钧崴电子	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	锁定期送股/转股
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股流通受限	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	锁定期送股/转股
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025年1月15日	6个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首	2025	6个月	新股	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-

	航新能	年3月26日		流通受限						
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	195	5,167.50	6,372.60	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股流通受限	46.50	42.85	172	7,998.00	7,370.20	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股流通受限	93.50	90.66	58	5,423.00	5,258.28	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞	2025年3月28日	6个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-

	林									
603271	永杰新材	2025 年3月 4日	6个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603400	华之杰	2025 年6月 12日	6个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年2月 25日	6个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年1月 20日	6个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年1月 15日	6个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025 年1月 8日	6个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	锁定 期送 股/转 股
688755	汉邦科技	2025 年5月 9日	6个月	新股 流通 受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年3月 18日	6个月	新股 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年1月 2日	6个月	新股 流通 受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年6月 4日	6个月	新股 流通 受限	47.27	124.16	282	13,330.14	35,013.12	-

注：1、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中需要限售的部分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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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按合同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。

本基金主要投资品种符合合同规定，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约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。

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或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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,501,614.35	-	-	-	18,501,614.35
结算备付金	5,604.48	-	-	-	5,604.48
存出保证金	15,214.70	-	-	-	15,214.70
交易性金融资产	-	-	-	340,625,634.57	340,625,634.57
应收股利	-	-	-	857,749.92	857,749.92
应收清算款	-	-	-	745,522.09	745,522.09
资产总计	18,522,433.53	-	-	342,228,906.58	360,751,340.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	149,759.21	149,759.21
应付托管费	-	-	-	29,951.84	29,951.84
应付清算款	-	-	-	2,384,270.40	2,384,270.40
其他负债	-	-	-	86,675.57	86,675.57
负债总计	-	-	-	2,650,657.02	2,650,657.02
利率敏感度缺口	18,522,433.53	-	-	339,578,249.56	358,100,683.09
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,956,340.51	-	-	-	21,956,340.51
结算备付金	27,763.45	-	-	-	27,763.45
存出保证金	8,004.22	-	-	-	8,004.22
交易性金融资产	-	-	-	373,592,303.21	373,592,303.21
应收股利	-	-	-	43,344.18	43,344.18
应收清算款	-	-	-	1,560,283.11	1,560,283.11
资产总计	21,992,108.18	-	-	375,195,930.50	397,188,038.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	171,340.33	171,340.33
应付托管费	-	-	-	34,268.06	34,268.06
应付清算款	-	-	-	1,970,627.52	1,970,627.52
其他负债	-	-	-	176,120.28	176,120.28
负债总计	-	-	-	2,352,356.19	2,352,356.19
利率敏感度缺口	21,992,108.18	-	-	372,843,574.31	394,835,682.49

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：本基金持有的利率敏感性资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金

净资产无重大影响。

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或负债，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 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	159, 101, 466. 81	-	159, 101, 466. 81
资产合计	-	159, 101, 466. 81	-	159, 101, 466. 81
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	-	159, 101, 466. 81	-	159, 101, 466. 81
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	158, 318, 333. 46	-	158, 318, 333. 46
资产合计	-	158, 318, 333. 46	-	158, 318, 333. 46
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	-	158, 318, 333. 46	-	158, 318, 333. 46

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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	港币-5%	-7,955,073.34	-7,915,916.67
	港币 5%	7,955,073.34	7,915,916.67

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包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	340,625,634.57	95.12	373,592,303.21	94.62
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	340,625,634.57	95.12	373,592,303.21	94.62

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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	17,072,001.73	18,911,717.69
	业绩比较基准下降 5%	-17,072,001.73	-18,911,717.69

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	340,169,491.83	372,874,776.58
第二层次	15,385.54	356,968.50
第三层次	440,757.20	360,558.13

合计	340,625,634.57	373,592,303.21
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 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	340,625,634.57	94.42
	其中：股票	340,625,634.57	94.42
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	18,507,218.83	5.13
8	其他各项资产	1,618,486.71	0.45
9	合计	360,751,340.11	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 159,101,466.81 元，占期末净值比例为 44.43%。

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	1,662,861.00	0.46
B	采矿业	9,209,680.95	2.57
C	制造业	94,125,329.20	26.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,336,916.00	1.77
E	建筑业	3,157,744.00	0.88
F	批发和零售业	560,838.77	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	6,194,970.14	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,519,690.43	2.38
J	金融业	46,247,685.59	12.91
K	房地产业	1,241,418.00	0.35
L	租赁和商务服务业	1,537,899.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,802,146.50	0.50
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	470,845.44	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	181,068,025.02	50.56

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	425,495.54	0.12
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	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	28,403.20	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	456,142.74	0.13

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	1,383,072.49	0.39
消费者非必需品	34,533,918.67	9.64
消费者常用品	4,119,722.29	1.15
能源	5,204,119.28	1.45
金融	50,290,458.55	14.04
医疗保健	4,944,091.34	1.38
工业	5,676,015.10	1.59
信息技术	12,810,448.02	3.58
电信服务	31,170,398.11	8.70
公用事业	3,858,025.91	1.08
地产建筑业	5,111,197.05	1.43
合计	159,101,466.81	44.43

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	52,300	23,990,577.46	6.70
2	09988	阿里巴巴-W	155,200	15,540,503.47	4.34

3	00005	汇丰控股	142,800	12,365,002.38	3.45
4	01810	小米集团-W	147,800	8,080,433.29	2.26
5	601318	中国平安	86,970	4,825,095.60	1.35
5	02318	中国平安	60,500	2,750,372.80	0.77
6	00939	建设银行	978,000	7,063,745.83	1.97
6	601939	建设银行	54,200	511,648.00	0.14
7	600519	贵州茅台	5,000	7,047,600.00	1.97
8	600036	招商银行	100,000	4,595,000.00	1.28
8	03968	招商银行	37,500	1,875,767.16	0.52
9	01398	工商银行	706,000	4,004,664.27	1.12
9	601398	工商银行	282,900	2,147,211.00	0.60
10	01211	比亚迪股份	30,000	3,351,416.25	0.94
10	002594	比亚迪	7,300	2,422,943.00	0.68
11	03690	美团-W	49,720	5,681,371.90	1.59
12	01299	友邦保险	86,400	5,546,990.59	1.55
13	300750	宁德时代	21,291	5,370,016.02	1.50
14	00941	中国移动	50,500	4,011,257.67	1.12
14	600941	中国移动	7,300	821,615.00	0.23
15	00388	香港交易所	10,300	3,933,824.00	1.10
16	601899	紫金矿业	133,100	2,595,450.00	0.72
16	02899	紫金矿业	50,000	914,229.88	0.26
17	03988	中国银行	680,000	2,827,774.56	0.79
17	601988	中国银行	115,900	651,358.00	0.18
18	000333	美的集团	39,700	2,866,340.00	0.80
18	00300	美的集团	5,300	359,841.79	0.10
19	601166	兴业银行	134,200	3,132,228.00	0.87
20	00981	中芯国际	39,000	1,589,802.44	0.44
20	688981	中芯国际	16,124	1,421,653.08	0.40
21	600900	长江电力	98,800	2,977,832.00	0.83
22	00883	中国海洋石油	145,000	2,343,164.33	0.65
22	600938	中国海油	19,300	503,923.00	0.14
23	601288	农业银行	258,000	1,517,040.00	0.42
23	01288	农业银行	250,000	1,276,730.00	0.36
24	601328	交通银行	215,500	1,724,000.00	0.48
24	03328	交通银行	143,000	951,984.61	0.27
25	600030	中信证券	78,810	2,176,732.20	0.61
25	06030	中信证券	15,000	324,198.23	0.09
26	300059	东方财富	102,199	2,363,862.87	0.66
27	02888	渣打集团	19,100	2,280,048.27	0.64
28	600276	恒瑞医药	36,040	1,870,476.00	0.52
29	000858	五 粮 液	15,632	1,858,644.80	0.52
30	601088	中国神华	26,700	1,082,418.00	0.30
30	01088	中国神华	27,500	763,644.13	0.21

31	00857	中国石油股份	172,000	1,058,773.95	0.30
31	601857	中国石油	91,500	782,325.00	0.22
32	601211	国泰海通	91,278	1,748,886.48	0.49
33	000651	格力电器	36,200	1,626,104.00	0.45
34	09992	泡泡玛特	6,600	1,604,630.74	0.45
35	02628	中国人寿	61,000	1,048,049.42	0.29
35	601628	中国人寿	13,500	556,065.00	0.16
36	601601	中国太保	27,600	1,035,276.00	0.29
36	02601	中国太保	22,600	553,380.38	0.15
37	06160	百济神州	11,600	1,563,520.04	0.44
38	601728	中国电信	125,300	971,075.00	0.27
38	00728	中国电信	114,000	580,109.63	0.16
39	600887	伊利股份	51,100	1,424,668.00	0.40
40	002475	立讯精密	41,000	1,422,290.00	0.40
41	600919	江苏银行	118,600	1,416,084.00	0.40
42	01024	快手-W	24,400	1,408,525.01	0.39
43	603259	药明康德	20,160	1,402,128.00	0.39
44	00386	中国石油化工股份	196,000	734,630.44	0.21
44	600028	中国石化	117,700	663,828.00	0.19
45	601816	京沪高铁	237,000	1,362,750.00	0.38
46	600000	浦发银行	94,800	1,315,824.00	0.37
47	600690	海尔智家	30,300	750,834.00	0.21
47	06690	海尔智家	23,200	474,980.04	0.13
48	02015	理想汽车-W	12,200	1,190,459.53	0.33
49	000725	京东方 A	296,900	1,184,631.00	0.33
50	00669	创科实业	15,000	1,180,519.28	0.33
51	002371	北方华创	2,600	1,149,746.00	0.32
52	300760	迈瑞医疗	4,900	1,101,275.00	0.31
53	02388	中银香港	34,500	1,072,863.58	0.30
54	688041	海光信息	7,542	1,065,609.18	0.30
55	300308	中际旭创	7,200	1,050,192.00	0.29
56	300502	新易盛	8,000	1,016,160.00	0.28
57	09868	小鹏汽车-W	15,500	997,946.89	0.28
58	00002	中电控股	16,500	994,618.27	0.28
59	688256	寒武纪	1,648	991,272.00	0.28
60	00016	新鸿基地产	12,000	985,453.17	0.28
61	300124	汇川技术	15,250	984,692.50	0.27
62	02020	安踏体育	11,400	982,443.74	0.27
63	09987	百胜中国	3,050	977,400.65	0.27
64	00001	长和	22,000	969,038.07	0.27
65	601668	中国建筑	167,000	963,590.00	0.27
66	600016	民生银行	200,200	950,950.00	0.27
67	000001	平安银行	78,500	947,495.00	0.26

68	002352	顺丰控股	19,400	945,944.00	0.26
69	00998	中信银行	85,000	579,817.81	0.16
69	601998	中信银行	42,900	364,650.00	0.10
70	01801	信达生物	13,000	929,459.44	0.26
71	002714	牧原股份	22,100	928,421.00	0.26
72	002230	科大讯飞	18,700	895,356.00	0.25
73	601658	邮储银行	89,000	486,830.00	0.14
73	01658	邮储银行	81,000	404,796.37	0.11
74	601127	赛力斯	6,600	886,512.00	0.25
75	02423	贝壳-W	20,500	886,141.82	0.25
76	603501	豪威集团	6,870	876,955.50	0.24
77	600031	三一重工	48,000	861,600.00	0.24
78	601229	上海银行	80,184	850,752.24	0.24
79	000063	中兴通讯	26,100	847,989.00	0.24
80	603019	中科曙光	11,800	830,720.00	0.23
81	002415	海康威视	29,800	826,354.00	0.23
82	600309	万华化学	15,200	824,752.00	0.23
83	601169	北京银行	119,300	814,819.00	0.23
84	300274	阳光电源	11,640	788,842.80	0.22
85	02328	中国财险	56,000	776,251.84	0.22
86	02269	药明生物	33,000	771,920.08	0.22
87	601919	中远海控	50,970	766,588.80	0.21
88	688008	澜起科技	9,173	752,186.00	0.21
89	601688	华泰证券	41,400	737,334.00	0.21
90	600660	福耀玻璃	12,900	735,429.00	0.21
91	601012	隆基绿能	48,960	735,379.20	0.21
92	300498	温氏股份	43,000	734,440.00	0.21
93	600406	国电南瑞	32,475	727,764.75	0.20
94	002142	宁波银行	26,590	727,502.40	0.20
95	00175	吉利汽车	49,000	713,181.38	0.20
96	01109	华润置地	29,000	703,478.23	0.20
97	600809	山西汾酒	3,960	698,504.40	0.20
98	00267	中信股份	71,000	697,988.29	0.19
99	601766	中国中车	98,300	692,032.00	0.19
100	601138	工业富联	32,000	684,160.00	0.19
101	600050	中国联通	126,100	673,374.00	0.19
102	000338	潍柴动力	43,600	670,568.00	0.19
103	000568	泸州老窖	5,900	669,060.00	0.19
104	603986	兆易创新	5,280	668,078.40	0.19
105	000100	TCL 科技	151,980	658,073.40	0.18
106	00011	恒生银行	6,100	654,196.45	0.18
107	300476	胜宏科技	4,800	645,024.00	0.18
108	688012	中微公司	3,537	644,795.10	0.18

109	601006	大秦铁路	97,500	643,500.00	0.18
110	600926	杭州银行	37,200	625,704.00	0.17
111	601985	中国核电	66,600	620,712.00	0.17
112	601818	光大银行	149,500	620,425.00	0.17
113	601225	陕西煤业	31,300	602,212.00	0.17
114	00992	联想集团	70,000	601,339.83	0.17
115	600104	上汽集团	37,400	600,270.00	0.17
116	09633	农夫山泉	16,400	599,734.80	0.17
117	002027	分众传媒	81,800	597,140.00	0.17
118	600150	中国船舶	18,100	588,974.00	0.16
119	00027	银河娱乐	18,000	572,066.24	0.16
120	600418	江淮汽车	14,100	565,269.00	0.16
121	601009	南京银行	47,600	553,112.00	0.15
122	00006	电能实业	12,000	552,094.53	0.15
123	00003	香港中华煤气	90,950	546,586.81	0.15
124	605499	东鹏饮料	1,720	540,166.00	0.15
125	01113	长实集团	17,000	536,408.99	0.15
126	09660	地平线机器人 -W	90,600	536,221.13	0.15
127	600999	招商证券	30,100	529,459.00	0.15
128	688111	金山办公	1,886	528,174.30	0.15
129	688271	联影医疗	4,110	525,011.40	0.15
130	600760	中航沈飞	8,941	524,121.42	0.15
131	603288	海天味业	13,461	523,767.51	0.15
132	000425	徐工机械	66,400	515,928.00	0.14
133	000625	长安汽车	40,184	512,747.84	0.14
134	000792	盐湖股份	29,900	510,692.00	0.14
135	600111	北方稀土	20,400	507,960.00	0.14
136	09926	康方生物	6,000	503,122.82	0.14
137	00288	万洲国际	73,000	502,621.24	0.14
138	600436	片仔癀	2,500	500,025.00	0.14
139	02057	中通快递-W	3,900	492,589.79	0.14
140	600905	三峡能源	115,400	491,604.00	0.14
141	300033	同花顺	1,800	491,418.00	0.14
142	002625	光启技术	12,200	487,756.00	0.14
143	600089	特变电工	40,860	487,459.80	0.14
144	00168	青岛啤酒股份	6,000	280,424.63	0.08
144	600600	青岛啤酒	2,900	201,434.00	0.06
145	601888	中国中免	7,900	481,663.00	0.13
146	002050	三花智控	18,200	480,116.00	0.13
147	603993	洛阳钼业	56,700	477,414.00	0.13
148	300015	爱尔眼科	37,728	470,845.44	0.13
149	600048	保利发展	57,900	468,990.00	0.13
150	600019	宝钢股份	70,800	466,572.00	0.13

151	600547	山东黄金	14,600	466,178.00	0.13
152	601390	中国中铁	82,800	464,508.00	0.13
153	002463	沪电股份	10,900	464,122.00	0.13
154	01093	石药集团	66,000	463,452.99	0.13
155	002241	歌尔股份	19,800	461,736.00	0.13
156	600415	小商品城	22,200	459,096.00	0.13
157	300014	亿纬锂能	10,000	458,100.00	0.13
158	601825	沪农商行	46,800	453,960.00	0.13
159	601600	中国铝业	63,900	449,856.00	0.13
160	01177	中国生物制药	92,000	441,310.84	0.12
161	00688	中国海外发展	35,500	440,936.94	0.12
162	601989	中国重工	92,300	428,272.00	0.12
163	00762	中国联通	50,000	424,056.75	0.12
164	000977	浪潮信息	8,300	422,304.00	0.12
165	600585	海螺水泥	19,400	416,518.00	0.12
166	600893	航发动力	10,800	416,232.00	0.12
167	002384	东山精密	11,000	415,470.00	0.12
168	601916	浙商银行	121,840	413,037.60	0.12
169	002179	中航光电	10,222	412,559.92	0.12
170	601838	成都银行	20,400	410,040.00	0.11
171	600570	恒生电子	12,212	409,590.48	0.11
172	00268	金蝶国际	29,000	408,334.73	0.11
173	06618	京东健康	10,400	407,824.04	0.11
174	603799	华友钴业	10,990	406,849.80	0.11
175	600958	东方证券	42,020	406,753.60	0.11
176	600015	华夏银行	51,400	406,574.00	0.11
177	000538	云南白药	7,220	402,803.80	0.11
178	000776	广发证券	23,900	401,759.00	0.11
179	002311	海大集团	6,700	392,553.00	0.11
180	02382	舜宇光学科技	6,200	392,111.14	0.11
181	601336	新华保险	6,700	391,950.00	0.11
182	00788	中国铁塔	38,300	391,888.63	0.11
183	000938	紫光股份	16,200	388,638.00	0.11
184	600584	长电科技	11,500	387,435.00	0.11
185	00066	港铁公司	15,000	385,754.85	0.11
186	02319	蒙牛乳业	26,000	381,742.27	0.11
187	601727	上海电气	51,200	378,368.00	0.11
188	02313	申洲国际	7,400	376,562.39	0.11
189	02688	新奥能源	6,500	371,665.22	0.10
190	01378	中国宏桥	22,500	368,929.37	0.10
191	600438	通威股份	21,900	366,825.00	0.10
192	000166	申万宏源	72,700	364,954.00	0.10
193	002028	思源电气	5,000	364,550.00	0.10

194	300408	三环集团	10,900	364,060.00	0.10
195	09626	哔哩哔哩-W	2,380	363,982.96	0.10
196	01171	兖矿能源	26,400	188,029.50	0.05
196	600188	兖矿能源	14,335	174,456.95	0.05
197	300433	蓝思科技	16,200	361,260.00	0.10
198	01519	极兔速递-W	58,000	358,615.22	0.10
199	002049	紫光国微	5,440	358,278.40	0.10
200	601077	渝农商行	50,100	357,714.00	0.10
201	000002	万 科 A	54,900	352,458.00	0.10
202	600795	国电电力	72,200	349,448.00	0.10
203	601377	兴业证券	56,110	347,320.90	0.10
204	600489	中金黄金	23,400	342,342.00	0.10
205	601669	中国电建	69,300	337,491.00	0.09
206	601995	中金公司	9,400	332,384.00	0.09
207	601689	拓普集团	6,985	330,041.25	0.09
208	00020	商汤-W	241,000	327,472.13	0.09
209	002422	科伦药业	9,100	326,872.00	0.09
210	600010	包钢股份	181,900	325,601.00	0.09
211	02331	李宁	21,000	324,034.07	0.09
212	600009	上海机场	10,100	320,877.00	0.09
213	600522	中天科技	22,100	319,566.00	0.09
214	600160	巨化股份	10,900	312,612.00	0.09
215	002460	赣锋锂业	9,180	310,008.60	0.09
216	002304	洋河股份	4,800	309,840.00	0.09
217	601100	恒立液压	4,300	309,600.00	0.09
218	000768	中航西飞	11,300	308,942.00	0.09
219	300394	天孚通信	3,820	304,988.80	0.09
220	01997	九龙仓置业	15,000	303,679.35	0.08
221	601881	中国银河	17,600	301,840.00	0.08
222	00012	恒基地产	12,000	300,396.33	0.08
223	01308	海丰国际	13,000	298,162.05	0.08
224	601186	中国铁建	37,100	297,171.00	0.08
225	688036	传音控股	3,723	296,723.10	0.08
226	00291	华润啤酒	13,000	296,383.75	0.08
227	600183	生益科技	9,800	295,470.00	0.08
228	002252	上海莱士	42,800	294,036.00	0.08
229	01928	金沙中国有限公司	19,600	292,064.75	0.08
230	000157	中联重科	40,200	290,646.00	0.08
231	601360	三六零	28,400	289,680.00	0.08
232	600839	四川长虹	29,800	289,656.00	0.08
233	00083	信和置业	38,000	289,361.74	0.08
234	600989	宝丰能源	17,800	287,292.00	0.08
235	000963	华东医药	7,100	286,556.00	0.08

236	600886	国投电力	19,300	284,482.00	0.08
237	01038	长江基建集团	6,000	284,254.82	0.08
238	03888	金山软件	7,600	283,470.54	0.08
239	002074	国轩高科	8,700	282,402.00	0.08
240	601788	光大证券	15,700	282,286.00	0.08
241	601555	东吴证券	32,178	281,557.50	0.08
242	688169	石头科技	1,793	280,694.15	0.08
243	601058	赛轮轮胎	21,300	279,456.00	0.08
244	600115	中国东航	69,100	278,473.00	0.08
245	00836	华润电力	16,000	276,357.33	0.08
246	300442	润泽科技	5,500	272,415.00	0.08
247	03692	翰森制药	10,000	271,305.13	0.08
248	002466	天齐锂业	8,400	269,136.00	0.08
249	000408	藏格矿业	6,300	268,821.00	0.08
250	000807	云铝股份	16,800	268,464.00	0.07
251	000661	长春高新	2,700	267,786.00	0.07
252	002736	国信证券	23,100	266,112.00	0.07
253	600066	宇通客车	10,700	266,002.00	0.07
254	002340	格林美	41,600	264,160.00	0.07
255	002001	新 和 成	12,400	263,748.00	0.07
256	601901	方正证券	33,200	262,612.00	0.07
257	600196	复星医药	10,400	260,936.00	0.07
258	600426	华鲁恒升	11,960	259,173.20	0.07
259	603893	瑞芯微	1,700	258,162.00	0.07
260	001979	招商蛇口	29,400	257,838.00	0.07
261	600029	南方航空	43,600	257,240.00	0.07
262	300661	圣邦股份	3,523	256,368.71	0.07
263	002236	大华股份	16,100	255,668.00	0.07
264	601800	中国交建	28,600	254,254.00	0.07
265	000975	山金国际	13,400	253,796.00	0.07
266	600011	华能国际	35,500	253,470.00	0.07
267	600674	川投能源	15,800	253,432.00	0.07
268	601066	中信建投	10,500	252,525.00	0.07
269	301236	软通动力	4,600	251,344.00	0.07
270	002156	通富微电	9,800	251,076.00	0.07
271	688126	沪硅产业	13,373	250,342.56	0.07
272	00135	昆仑能源	36,000	250,166.12	0.07
273	06969	思摩尔国际	15,000	249,509.52	0.07
274	600487	亨通光电	16,000	244,800.00	0.07
275	06862	海底捞	18,000	244,584.99	0.07
276	600346	恒力石化	17,100	243,846.00	0.07
277	601878	浙商证券	22,200	242,202.00	0.07
278	00151	中国旺旺	48,000	239,879.33	0.07

279	601111	中国国航	30,300	239,067.00	0.07
280	300418	昆仑万维	7,100	238,773.00	0.07
281	002916	深南电路	2,210	238,260.10	0.07
282	600372	中航机载	19,646	236,930.76	0.07
283	688777	中控技术	5,270	236,675.70	0.07
284	002920	德赛西威	2,300	234,899.00	0.07
285	600745	闻泰科技	7,000	234,710.00	0.07
286	002648	卫星化学	13,532	234,509.56	0.07
287	603369	今世缘	6,000	233,580.00	0.07
288	600460	士兰微	9,400	233,308.00	0.07
289	601868	中国能建	104,500	233,035.00	0.07
290	003816	中国广核	64,000	232,960.00	0.07
291	000066	中国长城	15,700	232,360.00	0.06
292	02367	巨子生物	4,400	231,525.87	0.06
293	06186	中国飞鹤	44,000	229,118.32	0.06
294	600096	云天化	10,300	226,291.00	0.06
295	601117	中国化学	29,500	226,265.00	0.06
296	601319	中国人保	25,900	225,589.00	0.06
297	00241	阿里健康	52,000	224,777.44	0.06
298	600741	华域汽车	12,700	224,155.00	0.06
299	300347	泰格医药	4,200	223,944.00	0.06
300	600588	用友网络	16,736	223,760.32	0.06
301	301269	华大九天	1,800	222,984.00	0.06
302	601168	西部矿业	13,400	222,842.00	0.06
303	601021	春秋航空	4,000	222,600.00	0.06
304	600176	中国巨石	19,394	221,091.60	0.06
305	600256	广汇能源	36,600	220,332.00	0.06
306	300782	卓胜微	3,084	220,105.08	0.06
307	601633	长城汽车	10,200	219,096.00	0.06
308	300450	先导智能	8,780	218,183.00	0.06
309	00285	比亚迪电子	7,500	217,500.08	0.06
310	002601	龙佰集团	13,400	217,214.00	0.06
311	600219	南山铝业	56,600	216,778.00	0.06
312	002555	三七互娱	12,500	216,125.00	0.06
313	000786	北新建材	8,100	214,488.00	0.06
314	300896	爱美客	1,220	213,268.20	0.06
315	688506	百利天恒	717	212,318.04	0.06
316	600885	宏发股份	9,488	211,677.28	0.06
317	000933	神火股份	12,700	211,328.00	0.06
318	302132	中航成飞	2,400	211,056.00	0.06
319	688396	华润微	4,454	210,050.64	0.06
320	600482	中国动力	9,100	209,937.00	0.06
321	600039	四川路桥	21,160	209,484.00	0.06

322	601108	财通证券	26,440	209,140.40	0.06
323	000630	铜陵有色	62,200	207,748.00	0.06
324	000895	双汇发展	8,400	205,044.00	0.06
325	02018	瑞声科技	5,500	204,140.01	0.06
326	002493	荣盛石化	24,550	203,274.00	0.06
327	002129	TCL 中环	26,375	202,560.00	0.06
328	603296	华勤技术	2,500	201,700.00	0.06
329	001965	招商公路	16,600	199,200.00	0.06
330	600085	同仁堂	5,500	198,330.00	0.06
331	01929	周大福	16,200	198,261.58	0.06
332	601877	正泰电器	8,700	197,229.00	0.06
333	600362	江西铜业	8,400	196,812.00	0.05
334	002709	天赐材料	10,800	195,696.00	0.05
335	02618	京东物流	16,300	195,323.27	0.05
336	03311	中国建筑国际	18,000	194,354.78	0.05
337	00960	龙湖集团	23,000	194,227.11	0.05
338	01209	华润万象生活	5,600	193,807.61	0.05
339	300223	北京君正	2,800	193,760.00	0.05
340	000423	东阿阿胶	3,700	193,510.00	0.05
341	002600	领益智造	22,500	193,275.00	0.05
342	300866	安克创新	1,700	193,120.00	0.05
343	300122	智飞生物	9,650	189,043.50	0.05
344	00322	康师傅控股	18,000	188,773.65	0.05
345	02097	蜜雪集团	400	187,496.92	0.05
346	603392	万泰生物	3,063	186,843.00	0.05
347	000783	长江证券	26,900	186,417.00	0.05
348	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.05
349	600161	天坛生物	9,680	185,759.20	0.05
350	688047	龙芯中科	1,387	185,011.93	0.05
351	00019	太古股份公司 A	3,000	183,985.91	0.05
352	002180	纳思达	8,000	183,520.00	0.05
353	002078	太阳纸业	13,600	183,056.00	0.05
354	300832	新产业	3,200	181,504.00	0.05
355	300765	新诺威	3,500	180,915.00	0.05
356	002128	电投能源	9,100	179,998.00	0.05
357	002938	鹏鼎控股	5,600	179,368.00	0.05
358	600233	圆通速递	13,900	179,171.00	0.05
359	00384	中国燃气	26,600	177,810.19	0.05
360	000301	东方盛虹	21,300	177,429.00	0.05
361	688072	拓荆科技	1,154	177,381.34	0.05
362	300759	康龙化成	7,175	176,074.50	0.05
363	603606	东方电缆	3,400	175,814.00	0.05
364	600023	浙能电力	32,800	173,840.00	0.05

365	002202	金风科技	16,900	173,225.00	0.05
366	601618	中国中冶	57,700	171,946.00	0.05
367	000876	新希望	18,200	170,716.00	0.05
368	03800	协鑫科技	186,000	169,622.70	0.05
369	600298	安琪酵母	4,800	168,816.00	0.05
370	000999	华润三九	5,394	168,724.32	0.05
371	688223	晶科能源	32,483	168,586.77	0.05
372	01972	太古地产	9,400	168,017.67	0.05
373	600875	东方电气	10,000	167,400.00	0.05
374	603605	珀莱雅	2,000	165,580.00	0.05
375	002271	东方雨虹	15,400	165,242.00	0.05
376	600845	宝信软件	6,929	163,662.98	0.05
377	601898	中煤能源	14,900	163,006.00	0.05
378	601872	招商轮船	26,000	162,760.00	0.05
379	600515	海南机场	45,800	162,132.00	0.05
380	03998	波司登	38,000	160,795.02	0.04
381	603659	璞泰来	8,546	160,493.88	0.04
382	002459	晶澳科技	15,884	158,522.32	0.04
383	00270	粤海投资	26,000	155,542.19	0.04
384	600061	国投资本	20,600	154,912.00	0.04
385	605117	德业股份	2,934	154,504.44	0.04
386	688599	天合光能	10,577	153,683.81	0.04
387	601799	星宇股份	1,200	150,000.00	0.04
388	600027	华电国际	27,400	149,878.00	0.04
389	601216	君正集团	27,000	149,040.00	0.04
390	600332	白云山	5,600	147,616.00	0.04
391	000617	中油资本	20,200	147,460.00	0.04
392	000932	华菱钢铁	33,200	146,080.00	0.04
393	600918	中泰证券	22,600	145,318.00	0.04
394	000983	山西焦煤	22,700	145,280.00	0.04
395	601233	桐昆股份	13,700	145,220.00	0.04
396	601696	中银证券	13,500	144,315.00	0.04
397	300628	亿联网络	4,140	143,906.40	0.04
398	300316	晶盛机电	5,300	143,895.00	0.04
399	600803	新奥股份	7,500	141,750.00	0.04
400	300999	金龙鱼	4,800	141,744.00	0.04
401	002414	高德红外	13,805	141,501.25	0.04
402	601698	中国卫通	6,900	141,243.00	0.04
403	600025	华能水电	14,700	140,385.00	0.04
404	002007	华兰生物	8,900	139,463.00	0.04
405	002812	恩捷股份	4,700	137,663.00	0.04
406	600642	申能股份	16,000	137,600.00	0.04
407	603260	合盛硅业	2,900	137,460.00	0.04

408	01193	华润燃气	7,500	137,134.48	0.04
409	09896	名创优品	4,200	136,354.76	0.04
410	03808	中国重汽	6,500	135,743.76	0.04
411	601059	信达证券	7,800	133,380.00	0.04
412	601238	广汽集团	17,700	132,573.00	0.04
413	688249	晶合集成	6,534	132,444.18	0.04
414	00881	中升控股	12,000	132,415.14	0.04
415	300413	芒果超媒	6,000	130,920.00	0.04
416	00144	招商局港口	10,000	130,408.85	0.04
417	600018	上港集团	22,800	130,188.00	0.04
418	300919	中伟股份	3,900	128,232.00	0.04
419	601567	三星医疗	5,700	127,794.00	0.04
420	600765	中航重机	7,500	126,600.00	0.04
421	00868	信义玻璃	18,000	123,769.85	0.03
422	00316	东方海外国际	1,000	121,654.13	0.03
423	601607	上海医药	6,700	119,796.00	0.03
424	603939	益丰药房	4,891	119,682.77	0.03
425	600026	中远海能	11,300	116,729.00	0.03
426	601018	宁波港	31,800	116,388.00	0.03
427	03668	兖煤澳大利亚	4,300	115,876.93	0.03
428	01585	雅迪控股	10,000	114,540.92	0.03
429	688188	柏楚电子	865	113,885.90	0.03
430	688303	大全能源	5,278	112,526.96	0.03
431	02380	中国电力	41,000	111,795.95	0.03
432	688472	阿特斯	12,063	110,376.45	0.03
433	600132	重庆啤酒	2,000	110,200.00	0.03
434	603195	公牛集团	2,268	109,431.00	0.03
435	00101	恒隆地产	16,000	109,288.09	0.03
436	02282	美高梅中国	9,200	108,062.43	0.03
437	603806	福斯特	8,318	107,801.28	0.03
438	00293	国泰航空	11,000	107,336.52	0.03
439	002939	长城证券	12,800	107,264.00	0.03
440	002064	华峰化学	16,000	105,760.00	0.03
441	688009	中国通号	20,566	105,709.24	0.03
442	601699	潞安环能	9,600	101,280.00	0.03
443	02588	中银航空租赁	1,700	100,770.48	0.03
444	00968	信义光能	44,000	99,913.24	0.03
445	01876	百威亚太	14,100	99,910.51	0.03
446	600985	淮北矿业	8,800	99,792.00	0.03
447	688728	格科微	6,246	96,188.40	0.03
448	000708	中信特钢	8,000	94,080.00	0.03
449	601865	福莱特	6,100	92,781.00	0.03
450	688187	时代电气	2,151	91,740.15	0.03

451	301308	江波龙	1,000	87,490.00	0.02
452	601136	首创证券	4,400	87,472.00	0.02
453	603899	晨光股份	3,000	86,970.00	0.02
454	603833	欧派家居	1,500	84,675.00	0.02
455	000987	越秀资本	12,230	83,897.80	0.02
456	688082	盛美上海	712	81,125.28	0.02
457	601231	环旭电子	5,400	79,002.00	0.02
458	300751	迈为股份	1,120	77,907.20	0.02
459	603198	迎驾贡酒	1,900	74,917.00	0.02
460	300979	华利集团	1,300	68,341.00	0.02
461	600968	海油发展	16,700	68,136.00	0.02
462	002032	苏泊尔	1,300	68,107.00	0.02
463	601808	中海油服	4,700	64,672.00	0.02
464	600377	宁沪高速	4,000	61,360.00	0.02
465	600350	山东高速	5,300	56,498.00	0.02
466	000800	一汽解放	8,000	54,880.00	0.02
467	600236	桂冠电力	8,700	54,549.00	0.02
468	001286	陕西能源	6,200	53,940.00	0.02
469	601298	青岛港	5,800	50,402.00	0.01
470	001391	国货航	7,058	47,500.34	0.01
471	001872	招商港口	1,900	37,734.00	0.01
472	601061	中信金属	4,400	34,804.00	0.01
473	002945	华林证券	2,100	30,177.00	0.01
474	001289	龙源电力	1,300	21,034.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
2	688775	影石创新	282	35,013.12	0.01
3	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
4	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
5	301275	汉朔科技	332	18,655.08	0.01
6	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
10	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
11	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
12	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
13	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
14	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
15	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
16	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00

17	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
18	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
19	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
20	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
21	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
22	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
23	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
24	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
25	603049	中策橡胶	172	7,370.20	0.00
26	603014	威高血净	195	6,372.60	0.00
27	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
28	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
29	603202	天有为	58	5,258.28	0.00
30	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
31	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
32	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
33	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
34	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
35	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
36	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
37	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
38	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
39	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
40	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	600519	贵州茅台	1,206,108.00	0.31
2	00700	腾讯控股	1,164,461.36	0.29
3	601211	国泰海通	1,110,804.64	0.28
4	02423	贝壳-W	978,847.21	0.25
5	09988	阿里巴巴-W	749,791.57	0.19
6	00005	汇丰控股	698,938.20	0.18
7	09660	地平线机器人-W	589,721.39	0.15
8	300476	胜宏科技	575,229.00	0.15
9	01810	小米集团-W	504,580.26	0.13
10	601166	兴业银行	492,557.00	0.12
11	01211	比亚迪股份	242,921.40	0.06
11	002594	比亚迪	182,124.00	0.05
12	300750	宁德时代	411,305.00	0.10
13	02318	中国平安	260,231.91	0.07

13	601318	中国平安	93,143.00	0.02
14	00939	建设银行	334,324.45	0.08
14	601939	建设银行	14,475.00	0.00
15	601328	交通银行	265,937.00	0.07
15	03328	交通银行	58,058.27	0.01
16	600839	四川长虹	299,481.00	0.08
17	01299	友邦保险	268,320.92	0.07
18	600036	招商银行	171,886.00	0.04
18	03968	招商银行	89,872.92	0.02
19	301236	软通动力	260,569.00	0.07
20	600487	亨通光电	252,291.00	0.06

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	5,924,748.27	1.50
2	09988	阿里巴巴-W	4,059,818.28	1.03
3	00005	汇丰控股	3,242,153.99	0.82
4	03690	美团-W	1,593,810.48	0.40
5	00939	建设银行	1,523,160.62	0.39
5	601939	建设银行	5,343.00	0.00
6	300750	宁德时代	1,526,639.00	0.39
7	01810	小米集团-W	1,468,270.91	0.37
8	01299	友邦保险	1,306,334.02	0.33
9	002594	比亚迪	699,000.00	0.18
9	01211	比亚迪股份	601,025.05	0.15
10	03988	中国银行	672,920.03	0.17
10	601988	中国银行	379,400.00	0.10
11	600837	海通证券	1,018,766.64	0.26
12	01398	工商银行	872,293.38	0.22
12	601398	工商银行	14,781.00	0.00
13	00941	中国移动	839,165.47	0.21
13	600941	中国移动	11,260.00	0.00
14	000333	美的集团	689,680.00	0.17
14	00300	美的集团	123,908.02	0.03
15	02318	中国平安	759,897.08	0.19
15	601318	中国平安	32,676.00	0.01
16	00388	香港交易所	719,030.08	0.18
17	00883	中国海洋石油	642,552.04	0.16
17	600938	中国海油	5,231.00	0.00
18	300059	东方财富	589,837.00	0.15
19	02888	渣打集团	567,398.47	0.14
20	000858	五粮液	506,455.00	0.13

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	27,733,067.35
卖出股票收入（成交）总额	67,614,954.32

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,214.70
2	应收清算款	745,522.09
3	应收股利	857,749.92
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	1,618,486.71

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	688411	海博思创	46,754.40	0.01	新股流通受限
2	688775	影石创新	35,013.12	0.01	新股流通受限
3	688545	兴福电子	26,788.30	0.01	新股流通受限
4	301458	钧崴电子	23,911.11	0.01	新股流通受限
5	301275	汉朔科技	18,655.08	0.01	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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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（%）

10,848	37,130.62	12,030,400.00	2.99	390,762,600.00	97.01
--------	-----------	---------------	------	----------------	-------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	竞技世界（北京）网络技术有限公司	5,000,000.00	1.24
2	王东博	3,952,800.00	0.98
3	中信建投证券股份有限公司	3,641,400.00	0.90
4	郑碧珍	3,000,000.00	0.74
5	王庆彦	2,889,600.00	0.72
6	芜湖珑盛裕智企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	2,000,000.00	0.50
7	奚锴全	1,584,000.00	0.39
8	王坤	1,500,000.00	0.37
9	赵秀君	1,486,500.00	0.37
10	舒仁荣	1,243,000.00	0.31

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	487,793,000.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	95,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	402,793,000.00

§ 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
本基金管理人于 2025 年 4 月 26 日发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，徐波先生自 2025 年 4 月 24 日起担任本基金管理人副总经理职务。
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，基金托管人无重大人事变动。

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

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
东方证券	2	70,715,336.03	77.29	12,832.36	80.05	-
开源证券	4	14,732,480.44	16.10	2,149.42	13.41	-
中信建投	2	4,528,424.39	4.95	826.89	5.16	撤销 2 个交易单元
国投证券	2	1,522,650.00	1.66	222.11	1.39	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
华西证券	4	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

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	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

		的比例 (%)		(%)		额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 (2024 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	2025 年 1 月 10 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	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2025 年 1 月 10 日

	更新》	网站	
3	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025 年 1 月 21 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 1 月 21 日
5	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 28 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 3 月 28 日
7	《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	2025 年 4 月 15 日
8	《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 21 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 4 月 21 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2025 年 5 月 31 日
11	《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	2025 年 6 月 3 日
12	《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 (2025 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	2025 年 6 月 3 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于增加财通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	2025 年 6 月 16 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于增加东方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	2025 年 6 月 18 日
15	《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	2025 年 6 月 27 日

§ 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 银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

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

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

12.1.4 《银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 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

2025 年 8 月 29 日