

银华恒生中国企业指数证券投资基金  
(QDII-LOF)  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	21
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	43
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	43
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	43

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	48
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	51
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	51
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	51
7.11 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）
基金简称	银华恒生国企指数（QDII-LOF）
场内简称	恒生国企 LOF（扩位证券简称）
基金主代码	161831
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	357,548,834.03 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 4 月 13 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争对恒生中国企业指数进行有效跟踪，并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 5% 以内，以实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用复制法，按照成份股在恒生中国企业指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪恒生中国企业指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	人民币/港币汇率×恒生中国企业指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。同时，本基金为境外证券投资基金，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、主要市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	李申
	联系电话	(010) 58163000	021-60637102

电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	021-60637111
传真	(010)58163027	021-60635778
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100738	100033
法定代表人	王珠林	田国立

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JPMorgan Chase Bank, HONG KONG BRANCH
	中文	-	摩根大通银行香港分行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		-	270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070
邮政编码		-	OH 43240

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-9,571,383.65
本期利润	-5,247,115.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0148
本期加权平均净值利润率	-2.33%
本期基金份额净值增长率	-3.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-71,585,172.35

期末可供分配基金份额利润	-0.2002
期末基金资产净值	236,924,100.15
期末基金份额净值	0.6626
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-28.35%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

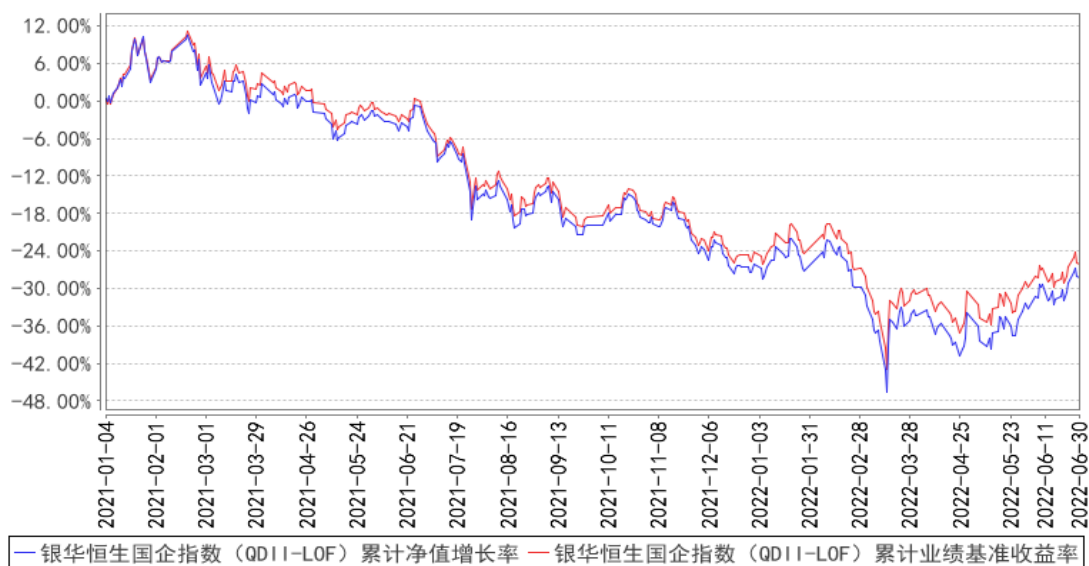
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.86%	1.91%	3.98%	1.77%	1.88%	0.14%
过去三个月	9.02%	2.35%	7.11%	2.13%	1.91%	0.22%
过去六个月	-3.09%	2.69%	-2.33%	2.44%	-0.76%	0.25%
过去一年	-26.36%	2.18%	-24.79%	1.99%	-1.57%	0.19%
自基金合同生效起至今	-28.35%	1.94%	-26.05%	1.78%	-2.30%	0.16%

### 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

银华恒生国企指数（QDII-LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五章的规定：投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的ETF的投资比例不低于基金资产的85%，其中，投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的80%；权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2.222亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司44.10%，第一创业证券股份有限公司26.10%，东北证券股份有限公司18.90%，山西海鑫实业有限公司0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。



截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 174 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞

和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中

证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
李璇士 宜女	本基金的 基金经理	2021 年 1 月 1 日	-	8 年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014 年 12 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 17 日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 7 日起兼任银华全球新能源车

					量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
乐 涛 生	育 先 本基金的 基金经理	2021 年 1 月 1 日	-	19 年	硕士学历。曾就职于 WorldCo 金融服务公司，主要从事自营证券投资工作；曾就职于 Binocular 资产管理公司，主要从事股指期货交易策略研究工作；并曾就职于 Evaluserve 咨询公司，曾任职投资研究部主管。2007 年 4 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任基金经理助理职务，自 2011 年 5 月 11 日起担任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2014 年 4 月 9 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 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。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、《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）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。

## 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

本基金主要采用组合复制策略以更好地跟踪标的指数恒生国企指数，实现基金投资目标。报告期内，本基金积极采取措施应对大额申赎对跟踪效果带来的影响。

### 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 0.6626 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.09%，业绩比较基准收益率为-2.33%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

作为一只投资于香港恒生国企指数的被动投资管理产品，本基金将在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，逐步降低前期产生的跟踪误差，力争投资回报与业绩比较基准保持一致。

## 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

本基金基金合同存续期内不进行利润分配。

## 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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	24,035,241.23	29,469,772.67
结算备付金		9,041,837.07	4,388,156.90
存出保证金		2,703,663.09	2,149,924.58
交易性金融资产	6.4.7.2	202,619,549.84	193,884,400.35
其中：股票投资		202,619,549.84	193,884,400.35
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		-	-
应收股利		1,320,135.53	28,952.61
应收申购款		309,356.78	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,803.35
资产总计		240,029,783.54	229,924,010.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,668,879.57	150,540.93
应付管理人报酬		188,553.78	193,543.08
应付托管费		52,795.04	54,192.07
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	195,455.00	245,875.83
负债合计		3,105,683.39	644,151.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	308,509,272.50	289,344,117.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-71,585,172.35	-60,064,259.40
净资产合计		236,924,100.15	229,279,858.55
负债和净资产总计		240,029,783.54	229,924,010.46

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 357,548,834.03 份，基金份额净值 0.6626。

## 6.2 利润表

会计主体：银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日(基金合同
-----	-----	------------------------------	--------------------------------



		6 月 30 日	生效日) 至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,663,704.07	7,409,780.79
1. 利息收入		37,583.78	65,626.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,583.78	65,626.19
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）		-8,565,610.51	34,418,523.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,000,780.29	28,523,801.15
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-817,079.22	2,408,401.38
股利收益	6.4.7.20	2,252,249.00	3,486,321.40
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）	6.4.7.21	4,324,268.19	-26,059,902.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		388,132.39	-1,813,141.67
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	151,922.08	798,674.74
<b>减：二、营业总支出</b>		1,583,411.39	4,918,635.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,110,640.14	2,138,121.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	310,979.19	598,673.95
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	21,517.32
8. 其他费用	6.4.7.24	161,792.06	2,160,323.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,247,115.46	2,491,144.88

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,247,115.46	2,491,144.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,247,115.46	2,491,144.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	289,344,117.95	-	-60,064,259.40	229,279,858.55
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)	289,344,117.95	-	-60,064,259.40	229,279,858.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	19,165,154.55	-	-11,520,912.95	7,644,241.60
(一)、综合收益总额	-	-	-5,247,115.46	-5,247,115.46
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值	19,165,154.55	-	-6,273,797.49	12,891,357.06

变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	89,428,283.68	-	-23,734,590.24	65,693,693.44
2 .基金赎 回款	-70,263,129.13	-	17,460,792.75	-52,802,336.38
(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)	308,509,272.50	-	-71,585,172.35	236,924,100.15
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	775,121,235.99	-	55,700,626.24	830,821,862.23
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 )	775,121,235.99	-	55,700,626.24	830,821,862.23
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “- ” 号 填 列 )	-500,258,913.93	-	-43,933,401.63	-544,192,315.56
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	2,491,144.88	2,491,144.88
(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 )	-500,258,913.93	-	-46,424,546.51	-546,683,460.44
其中：1. 基 金 申 购 款	54,456,756.50	-	7,796,062.11	62,252,818.61
2 . 基 金 赎 回 款	-554,715,670.43	-	-54,220,608.62	-608,936,279.05
(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)	274,862,322.06	-	11,767,224.61	286,629,546.67

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

银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称“本基金”）由银华恒生中国企业指数分级证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而成。原基金系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[2013]1433 号《关于核准银华恒生中国企业指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）于 2014 年 3 月 10 日至 2014 年 4 月 2 日向社会公开募集，首次募集规模为 303,487,507.99 份基金份额。基金合同于 2014 年 4 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人 2020 年 12 月 2 日发布的《关于银华恒生中国企业指数分级证券投资基金之恒中企 A 份额和恒中企 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，原基金的份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》、《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》于 2021 年 1 月 1 日生效，《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金合同》、《银华恒生中国企业指数分级证券投资基金托管协议》自同一起失效。自此，原基金的基金名称变更为“银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）”，基金场外简称由“银华恒生国企指数分级（QDII）”变更为“银华恒生国企指数（QDII-LOF）”，基金场内简称仍为“恒生中企”，基金代码仍为“161831”。基金管理人、基金托管人与注册登记机构不变，仍为银华基金管理股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、摩根大通银行香港分行（境外托管人）与中国证券登记结算有限责任公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的

ETF、以及在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、存托凭证、固定收益类证券、现金、短期金融工具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的相关规定）。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后（不需召开基金份额持有人大会），可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：人民币/港币汇率×恒生中国企业指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。

#### 6.4.2 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、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣



除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益：

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

## 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，

其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 29,469,772.67 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,803.35 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 29,472,576.02 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,803.35 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,803.35 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款	24,035,241.23
等于：本金	24,033,612.15	
加：应计利息	1,629.08	
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	24,035,241.23	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	251,278,548.31	-	202,619,549.84	-48,658,998.47
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	251,278,548.31	-	202,619,549.84	-48,658,998.47

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-
权益衍生工具	21,327,269.72	-	-
其中：股指期货投资	21,327,269.72	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	21,327,269.72	-	-

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 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：HHI2209 买入持仓量 65 手，合约市值人民币 21,053,708.81 元，公允价值变动人民币-273,560.91 元。

#### 6.4.7.3.2 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
HHI2209_ZX	HHI2209_中信	65.00	21,053,708.81	-273,560.91
合计				-273,560.91
减：可抵销期货暂收款				-273,560.91
净额				0.00

#### 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

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,556.17
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	164,055.34
应付指数使用费	21,843.49
合计	195,455.00

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	335,337,253.12	289,344,117.95
本期申购	103,643,492.75	89,428,283.68
本期赎回（以“-”号填列）	-81,431,911.84	-70,263,129.13
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	357,548,834.03	308,509,272.50

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	14,868,855.63	-74,933,115.03	-60,064,259.40
本期利润	-9,571,383.65	4,324,268.19	-5,247,115.46
本期基金份额交易产生的变动数	883,918.38	-7,157,715.87	-6,273,797.49
其中：基金申购款	3,490,324.87	-27,224,915.11	-23,734,590.24
基金赎回款	-2,606,406.49	20,067,199.24	17,460,792.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,181,390.36	-77,766,562.71	-71,585,172.35

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,583.78
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	-
其他	-
合计	37,583.78

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,000,780.29
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-10,000,780.29

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	24,134,388.02
减：卖出股票成本总额	33,981,041.36
减：交易费用	154,126.95
买卖股票差价收入	-10,000,780.29

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.19.2 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6月30日
股指期货投资收益	-817,079.22

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,252,249.00
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	2,252,249.00

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	4,822,106.96
股票投资	4,822,106.96
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	-497,838.77
权证投资	-
期货投资	-497,838.77
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	4,324,268.19

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	151,922.08
合计	151,922.08



#### 6.4.7.23 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,311.15
指数使用费	44,425.57
上市费	29,752.78
合计	161,792.06

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行香港分行（“摩根大通银行”）	基金境外托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,110,640.14	2,138,121.59
其中：支付销售机构的客户维护费	248,980.53	293,404.18

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	310,979.19	598,673.95

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.28%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.28\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
摩根大通银行	6,155,727.74	-	15,974,786.56	-
中国建设银行	17,879,513.49	37,583.78	16,231,031.97	56,478.23

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

注：无。

## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
1918 HK	融创中国	2020年4月1日	重大事项停牌	3.92	-	-	123,000	2,514,999.82	481,762.73	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。由于本基金主要投资于股票和基金，生息资产主要为银行存款，无重大利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,035,241.23	-	-	-	24,035,241.23
结算备付金	9,041,837.07	-	-	-	9,041,837.07
存出保证金	2,703,663.09	-	-	-	2,703,663.09
交易性金融资产	-	-	-	-202,619,549.84	202,619,549.84
应收股利	-	-	-	1,320,135.53	1,320,135.53
应收申购款	-	-	-	309,356.78	309,356.78
应收清算款	-	-	-	-	273,560.91
资产总计	35,780,741.39	-	-	-204,249,042.15	240,029,783.54
负债					

应付赎回款	-	-	-	2,668,879.57	2,668,879.57
应付管理人报酬	-	-	-	188,553.78	188,553.78
应付托管费	-	-	-	52,795.04	52,795.04
其他负债	-	-	-	195,455.00	195,455.00
负债总计	-	-	-	3,105,683.39	3,105,683.39
利率敏感度缺口	35,780,741.39	-	-	-201,143,358.76	236,924,100.15
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	27,129,004.22	-	-	2,340,768.45	29,469,772.67
结算备付金	-	-	-	4,388,156.90	4,388,156.90
存出保证金	-	-	-	2,149,924.58	2,149,924.58
交易性金融资产	-	-	-	-193,884,400.35	193,884,400.35
应收利息	-	-	-	2,803.35	2,803.35
应收股利	-	-	-	28,952.61	28,952.61
资产总计	27,129,004.22	-	-	-202,795,006.24	229,924,010.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	150,540.93	150,540.93
应付管理人报酬	-	-	-	193,543.08	193,543.08
应付托管费	-	-	-	54,192.07	54,192.07
其他负债	-	-	-	245,875.83	245,875.83
负债总计	-	-	-	644,151.91	644,151.91
利率敏感度缺口	27,129,004.22	-	-	-202,150,854.33	229,279,858.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，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 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

以外币计价的资产				
银行存款	-	6,157,413.78	-	6,157,413.78
结算备付金	-	9,041,837.07	-	9,041,837.07
存出保证金	-	2,703,663.09	-	2,703,663.09
交易性金融资产	-	202,619,549.84	-	202,619,549.84
应收股利	-	1,320,135.53	-	1,320,135.53
资产合计	-	221,842,599.31	-	221,842,599.31
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	-	221,842,599.31	-	221,842,599.31
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	2,345,604.18	-	2,345,604.18
结算备付金	-	4,388,156.90	-	4,388,156.90
存出保证金	-	2,149,924.58	-	2,149,924.58
交易性金融资产	-	193,884,400.35	-	193,884,400.35
应收股利	-	28,952.61	-	28,952.61
应收利息	-	0.44	-	0.44
资产合计	-	202,797,039.06	-	202,797,039.06
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	-	202,797,039.06	-	202,797,039.06

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	港币 5%	11,092,129.97	10,139,851.95
	港币-5%	-11,092,129.97	-10,139,851.95

注：上表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。本基金的基金管理人通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对恒生国企指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的 ETF 的投资比例不低于基金资产的 85%，其中，本基金投资于标的指数成份股、备选股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	202,619,549.84	85.52	193,884,400.35	84.56
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	202,619,549.84	85.52	193,884,400.35	84.56

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变动 5%，且其他市场变量保持不变；		
	根据期末时点基金净资产相对于业绩比较基准的 Beta 系数计算资产变动幅度；		
	Beta 系数是根据本报告期所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	-5%	-12,944,360.43	-12,128,971.57
	5%	12,944,360.43	12,128,971.57

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。表格为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	202,137,787.11	193,884,400.35
第二层次	481,762.73	-
第三层次	-	-
合计	202,619,549.84	193,884,400.35

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	202,619,549.84	84.41
	其中：普通股	202,619,549.84	84.41
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-

	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,077,078.30	13.78
8	其他各项资产	4,333,155.40	1.81
9	合计	240,029,783.54	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	202,619,549.84	85.52
合计	202,619,549.84	85.52

注：1. 股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	70,705,839.25	29.84
消费者常用品	12,502,454.48	5.28
能源	7,930,621.57	3.35
金融	43,831,421.66	18.50
医疗保健	5,817,079.35	2.46
工业	2,636,704.71	1.11
信息技术	15,469,733.73	6.53
电信服务	27,437,881.76	11.58
公用事业	4,040,512.77	1.71
地产建筑业	12,247,300.56	5.17
合计	202,619,549.84	85.52

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Ho	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易	中国香港	215,700	20,641,575.65	8.71

	lding Limited			所				
2	Tencent Holdings Limited	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	57,100	17,305,830.09	7.3
3	Meituan	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	103,700	17,222,278.02	7.27
4	JD.COM INC - CLASS A	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	49,600	10,723,124.79	4.53
5	Ping An Insurance (Group) Co Of China	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	219,500	10,014,552.84	4.23
6	Industrial And Comm. Bank Of China Ltd	工商银行	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	2,511,000	10,006,800.54	4.22
7	Byd Company Limited	比亚迪股份	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	29,000	7,787,360.14	3.29
8	Bank Of China Limited	中国银行	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	2,695,000	7,213,826.97	3.04
9	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	608,400	7,096,859.21	3
10	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行	3968 HK	香港联合交易所	中国香港	136,000	6,106,056.60	2.58
11	Cnooc Limited	中国海洋	883 HK	香港联合交易所	中国香港	613,000	5,431,038.03	2.29
12	Kuaishou Technology	快手-W	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	71,400	5,336,693.47	2.25
13	Li Ning	李宁	2331 HK	香港联	中国	81,500	5,067,043.51	2.14

				合交易所	香港			
14	China Mengniu Dairy Company Limited	中国蒙牛	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	110,000	3,682,875.74	1.55
15	China Resources Land Limited	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	112,000	3,505,594.85	1.48
16	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车	175 HK	香港联合交易所	中国香港	203,000	3,097,087.69	1.31
17	Anta Sports Products Limited	安踏体育用品	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	37,400	3,083,267.82	1.3
18	China Life Insurance Company Limited	中国人寿	2628 HK	香港联合交易所	中国香港	256,000	2,990,565.22	1.26
19	Enn Energy Holdings Limited	新奥能源	2688 HK	香港联合交易所	中国香港	26,800	2,954,270.96	1.25
20	China Resources Beer (Holdings) Co Ltd	华润创业	291 HK	香港联合交易所	中国香港	56,000	2,801,602.44	1.18
21	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	131,000	2,778,341.27	1.17
22	Sunny Optical Technology (Gp) C	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	24,700	2,701,656.38	1.14

	o Ltd							
23	Netease, Inc.	网易-S	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	21,600	2,661,830.19	1.12
24	Nongfu Spring Co., Ltd.	农夫山泉	9633 HK	香港联合交易所	中国香港	68,800	2,650,610.09	1.12
25	Agricultural Bank Of China Limited	农业银行	1288 HK	香港联合交易所	中国香港	1,043,000	2,640,210.98	1.11
26	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石化	386 HK	香港联合交易所	中国香港	828,000	2,499,583.54	1.06
27	Shenzhen International Group Holdings Ltd	申洲国际集团	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	28,700	2,332,902.73	0.98
28	Semiconductor Manufacturing Intl Corp	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	148,500	2,308,782.10	0.97
29	Country Garden Services Holding Co Ltd	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	72,000	2,152,000.12	0.91
30	Baidu, Inc.	百度集团-SW	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	16,800	2,133,528.01	0.9
31	Jd Health International Inc.	京东健康	6618 HK	香港联合交易所	中国香港	39,500	2,079,159.31	0.88
32	Cspc Pharmaceutical Group Limited	石药集团	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	308,000	2,051,874.47	0.87
33	Longfor	龙湖地	960 HK	香港联	中国	64,500	2,043,668.92	0.86

	Group Holdings Limited	产		合交易所	香港			
34	Postal Savings Bank Of China Co., Ltd	邮储银行	1658 HK	香港联合交易所	中国香港	376,000	2,003,265.47	0.85
35	Xinyi Solar	信义光能	968 HK	香港联合交易所	中国香港	172,000	1,782,763.28	0.75
36	Citic Limited	中信股份	267 HK	香港联合交易所	中国香港	250,000	1,699,690.13	0.72
37	Sino Pharmaceutical Limited	中国生物制药	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	386,000	1,640,613.60	0.69
38	Lenovo Group	联想集团	992 HK	香港联合交易所	中国香港	252,000	1,579,672.76	0.67
39	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	中国太平洋保险	2601 HK	香港联合交易所	中国香港	90,200	1,479,509.49	0.62
40	Bank Of Communications Co., Ltd.	交通银行	3328 HK	香港联合交易所	中国香港	297,000	1,376,633.55	0.58
41	Innovent Bio	信达生物	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	45,500	1,357,998.96	0.57
42	China Feihe Limited	中国飞鹤	6186 HK	香港联合交易所	中国香港	167,000	1,288,206.90	0.54
43	Country Garden Holdings Company Ltd.	碧桂园	2007 HK	香港联合交易所	中国香港	295,000	1,226,085.90	0.52
44	China Gas Holdin	中国燃气	384 HK	香港联合交易	中国香港	104,800	1,086,241.81	0.46

	gs Limited			所				
45	JD Logistics	京东物流	2618 HK	香港联合交易所	中国香港	64,000	937,014.58	0.4
46	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康	241 HK	香港联合交易所	中国香港	166,000	766,592.32	0.32
47	Haidilao International Holding Ltd.	海底捞	6862 HK	香港联合交易所	中国香港	48,000	751,198.90	0.32
48	Sunac China Holdings Limited	融创中国控股	1918 HK	香港联合交易所	中国香港	123,000	481,762.73	0.2
49	Sunac Services Holdings Limited	融创服务	1516 HK	香港联合交易所	中国香港	14,671	59,846.77	0.03

注：1、证券代码采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Meituan	3690 HK	6,012,019.07	2.62
2	JD.COM INC - CL A	9618 HK	5,488,103.64	2.39
3	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	3,974,855.51	1.73
4	Tencent Holdings Limited	700 HK	3,430,266.48	1.5
5	Xinyi Solar	968 HK	1,840,558.80	0.8
6	Lenovo Group	992 HK	1,616,823.21	0.71
7	Ping An Insurance (Group) Co Of China	2318 HK	1,560,402.47	0.68
8	Baidu, Inc.	9888 HK	1,175,893.04	0.51
9	Industrial And C	1398 HK	1,016,256.24	0.44



	omm. Bank Of China Ltd			
10	China Mengniu Dairy Company Limited	2319 HK	656,318.93	0.29
11	Xiaomi Corporation	1810 HK	654,340.76	0.29
12	Bank Of China Limited	3988 HK	628,606.82	0.27
13	Cnooc Limited	883 HK	614,758.83	0.27
14	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	574,665.17	0.25
15	China Overseas Land and Investment Ltd	688 HK	463,002.81	0.2
16	Netease, Inc.	9999 HK	416,319.13	0.18
17	Shenzhen International Gp Holdings Ltd	2313 HK	400,007.74	0.17
18	China Resources Land Limited	1109 HK	396,526.40	0.17
19	Sunny Optical Technology (Gp) Co Ltd	2382 HK	381,895.11	0.17
20	Kuaishou Technology	1024 HK	354,146.41	0.15

注：1、以上权益投资所在证券市场为香港，所属国家为中国。

2、“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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Meituan	3690 HK	5,391,358.84	2.35
2	Kuaishou Technology	1024 HK	2,304,838.22	1.01
3	Ping An Insurance (Group) Co Of China	2318 HK	1,449,199.98	0.63
4	Industrial And Commercial Bank Of China Ltd	1398 HK	1,269,030.30	0.55
5	Alibaba Group Ho	9988 HK	903,375.18	0.39

	lding Limited			
6	Bank Of China Limited	3988 HK	896,293.68	0.39
7	Cnooc Limited	883 HK	793,416.98	0.35
8	Xiaomi Corporation	1810 HK	715,917.97	0.31
9	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	624,560.53	0.27
10	Hanson Pharama	3692 HK	540,410.86	0.24
11	China Overseas L and & Investment Ltd	688 HK	514,638.41	0.22
12	Shenzhou International Gp Holdings Ltd	2313 HK	489,355.73	0.21
13	Byd Company Limited	1211 HK	482,133.30	0.21
14	China Resources Land Limited	1109 HK	425,438.77	0.19
15	Sunny Optical Technology (Gp) Co Ltd	2382 HK	415,842.74	0.18
16	JD.COM INC - CL A	9618 HK	401,184.30	0.17
17	JD Logistics	2618 HK	392,834.59	0.17
18	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	376,154.06	0.16
19	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	373,426.81	0.16
20	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	361,616.84	0.16

注：1、以上权益投资所在证券市场为香港，所属国家为中国。

2、“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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	37,894,083.89
卖出收入（成交）总额	24,134,388.02

注：权益投资的“买入成本(成交)总额”和“卖出收入(成交)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。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_股指	HHI2209_中信	21,053,708.81	8.89

注：本基金本报告期末仅持有 1 只金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	2,703,663.09
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,320,135.53
4	应收利息	-
5	应收申购款	309,356.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,333,155.40

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末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。

#### 7.11.6 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，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 (%)
12,423	28,781.20	5,056,416.61	1.41	352,492,417.42	98.59

#### 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	刘加	5,415,234.00	2.40
2	郭相国	4,571,267.00	2.03
3	杨光	3,588,000.00	1.59
4	邵常红	3,446,893.00	1.53
5	黎宇明	2,965,145.00	1.32
6	丁桂生	2,332,900.00	1.03
7	杜永青	2,102,783.00	0.93
8	袁晖	1,972,713.00	0.88
9	周绍勋	1,933,568.00	0.86
10	宗洪良	1,836,339.00	0.81

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

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	165,458.10	0.05

#### 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 1 月 1 日) 基金份额总额	898,331,813.18
本报告期期初基金份额总额	335,337,253.12
本报告期基金总申购份额	103,643,492.75
减：本报告期基金总赎回份额	81,431,911.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	357,548,834.03

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

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

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券 (香港)	-	8,664,565.74	13.97	8,664.56	12.65	-
光大证券 (香港)	-	9,107,805.52	14.68	9,107.82	13.30	-
申银万国证券 (香港)	-	6,765,261.54	10.91	10,147.92	14.81	-
中银国际证券	-	7,592,272.19	12.24	11,388.41	16.62	-
交银国际证券	-	8,683,316.99	14.00	6,946.66	10.14	-
中信里昂证券	-	5,160,881.20	8.32	6,193.06	9.04	-
广发证券 (香港)	-	16,054,368.65	25.88	16,054.35	23.44	-

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

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

3、基金成交总额不含非上市(场外)基金的申购和赎回金额。

4、本基金本报告期末通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例

						(%)		(%)
招商证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
交银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信里昂证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）2021 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
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 01 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 01 月 24 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 03 月 28 日
5	《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）2021 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 29 日
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 03 月 29 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于旗	本基金管理人网站, 中	2022 年 04 月 12 日

	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》	中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	
8	《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）2022 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 20 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 04 月 20 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 04 月 25 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 05 月 06 日
12	《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）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 05 月 20 日
13	《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）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 05 月 20 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 06 月 28 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 中国证监会核准银华恒生中国企业指数分级证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》
- 12.1.3 《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）招募说明书》



12.1.4 《银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）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 本基金管理人业务资格批件和营业执照

12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

## 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 29 日