

银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>55</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	76
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	76
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>79</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
11.4 基金投资策略的改变 .....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	85
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>87</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>88</b>
13.1 备查文件目录 .....	88
13.2 存放地点 .....	88
13.3 查阅方式 .....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000 增强 ETF
场内简称	1000 增强 ETF
基金主代码	159677
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 24 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	86,904,091.00 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	2022 年 12 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强投资策略，主要包括（1）指数化投资策略：本基金指数化投资以标的指数的成份股组成及其权重为基础，确定本基金投资组合的基本构成和大致权重，并通过控制投资组合中个股权重对标的指数成份股权重的偏离，实现对标的指数的跟踪和对跟踪误差的控制。（2）量化增强投资策略：本基金将在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整，以争取实现指数增强的目标。</p> <p>本基金标的指数为中证 1000 指数。建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，采用指数增强投资策略跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	银华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	王小飞
	联系电话	(010)58163000	021-60637103
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	021-60637228	
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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年 11 月 24 日 (基金合同生效日) -2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	13,133,338.96	13,110,337.70
本期利润	18,500,938.57	5,418,712.70
加权平均基金份额本期利润	0.1184	0.0090
本期加权平均净值利润率	11.58%	0.90%
本期基金份额净值增长率	0.96%	-3.42%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-2,165,343.74	-8,833,206.94
期末可供分配基	-0.0249	-0.0342

金份额利润		
期末基金资产净值	84,738,747.26	249,070,884.06
期末基金份额净值	0.9751	0.9658
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-2.49%	-3.42%

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

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

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

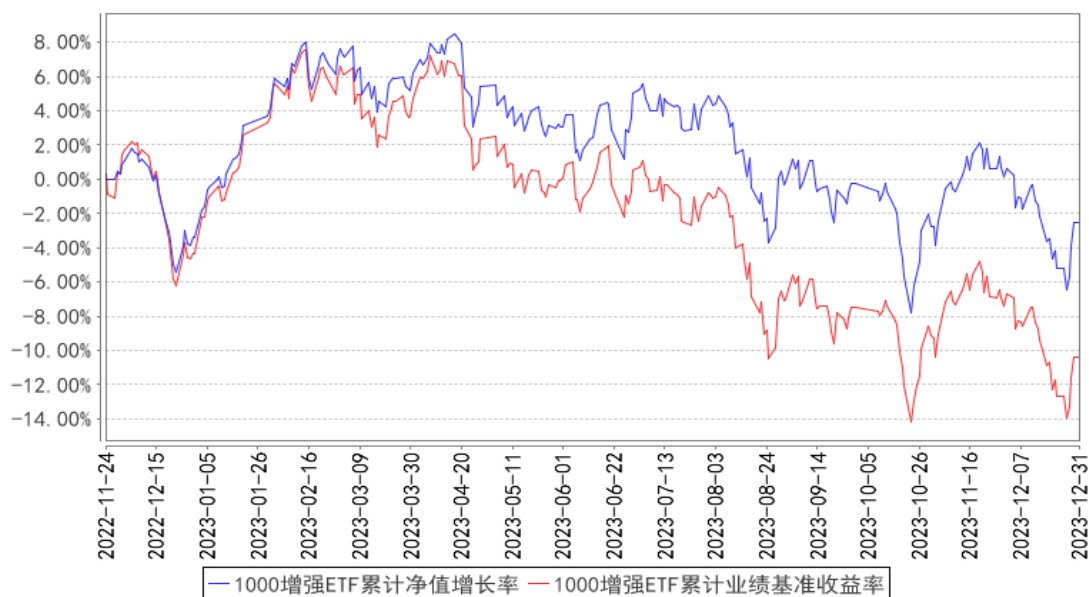
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.26%	0.99%	-3.15%	1.04%	0.89%	-0.05%
过去六个月	-7.15%	0.94%	-10.83%	1.00%	3.68%	-0.06%
过去一年	0.96%	0.87%	-6.28%	0.95%	7.24%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-2.49%	0.85%	-10.36%	0.94%	7.87%	-0.09%

### 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

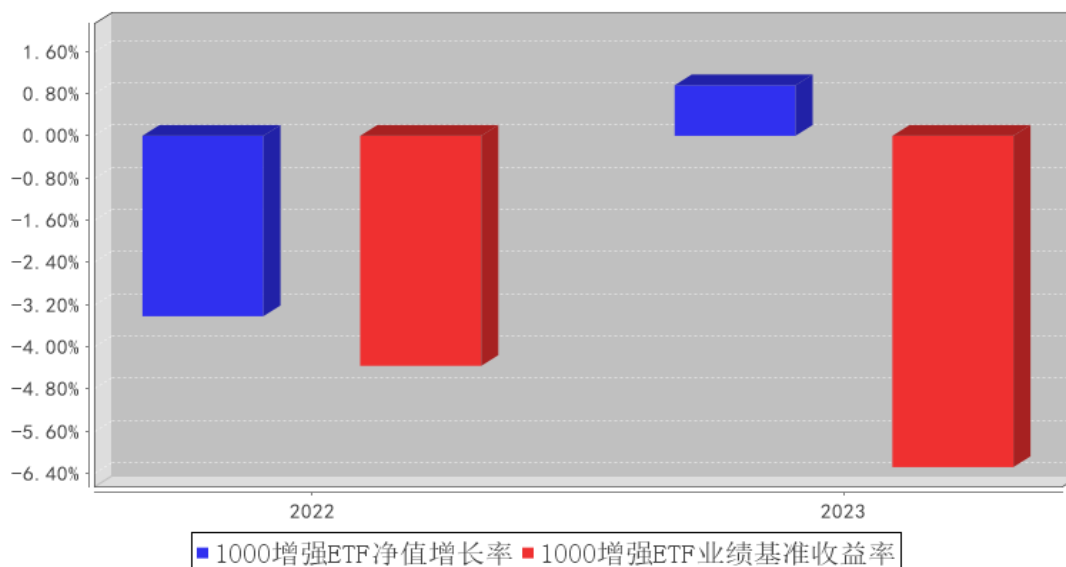
1000增强ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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

1000增强ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日止会计期间及2023年度未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2023年12月31日，本基金管理人管理197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、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、

银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、

银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、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、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金。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		
张凯先生	本基金的基金经理	2022 年 11 月 24 日	-	14.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投

				<p>资基金基金经理,自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理,自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理,自 2016 年 4 月 7 日起兼任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基金经理,自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理,自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理,自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 17 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 11 月 26 日至 2022 年 7 月 28 日兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理,自 2020 年 11 月 30 日起兼任银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理,自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理,自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 2 月 23 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 5 月 13 日至 2022 年 6 月 17 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 2021 年 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合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基金经理,自 2021 年 11 月 19 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地</p>
--	--	--	--	--

					<p>低碳经济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 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日兼任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基金经理，自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 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 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
王帅先生	本基金的基金经理	2022 年 11 月 24 日	-	11.5 年	<p>硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开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</p>

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					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。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2022 年 11 月 24 日	-	10 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、王帅先生自 2024 年 1 月 23 日起不再担任本基金基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗



下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 12 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9751 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.96%，业绩比较基准收益率为-6.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，宏观经济逐渐从疫情中走出，从年初以来，整体呈现了从脉冲反弹到脉冲回落，最终缓慢复苏的运行特点。分经济部门来看，居民出行、居民消费等领域处于持续的复苏通道中，这在各个节假日的数据中体现明显；同时，商务活动尤其是与地产链条相关的商务活动，复苏进程仍然较弱，这在消费价位段、投融资结构等数据上有所显现。从海外来看，美联储在全年内以加息为主，使得外汇和国际资本流动都面临新的环境特点。这些外部因素在年末也正在迎来边际上的变化。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在 2023 年表现不佳。

展望 2024 年我们认为，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。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢且持续的过程；而随着新旧更替的深入，经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期，国内政策、汇率水平、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，根据法律法规、监管规定和业务发展的需要，持续健全合规管理及监察稽核机制，

改进合规管理方式，提高合规管理能力，推进合规文化建设，提升合规管理工作的有效性。

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实“风险为本”反洗钱理念，健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处理事务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27635 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“1000 增强 ETF”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度和 2022 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会</p>

	(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了1000增强ETF2023年12月31日和2022年12月31日的财务状况以及2023年度和2022年11月24日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于1000增强ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	1000增强ETF的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估1000增强ETF的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算1000增强ETF、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督1000增强ETF的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对 1000 增强 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致 1000 增强 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2023 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,803,080.73	7,269,728.25
结算备付金		469,578.46	5,467,740.66
存出保证金		121,201.22	121,365.22
交易性金融资产	7.4.7.2	82,736,659.53	240,998,472.09
其中:股票投资		82,736,659.53	240,998,472.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中:债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,350,488.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		85,130,519.94	255,207,794.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,275,762.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,425.99	204,484.83
应付托管费		7,285.21	40,896.97
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	7.4.7.9	348,061.48	1,615,766.06
负债合计		391,772.68	6,136,910.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	86,904,091.00	257,904,091.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-2,165,343.74	-8,833,206.94
净资产合计		84,738,747.26	249,070,884.06
负债和净资产总计		85,130,519.94	255,207,794.62

注：1、报告截止日2023年12月31日，基金份额净值0.9751元，基金份额总额86,904,091.00份。

2、本财务报表的实际编制期间为2023年度和2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：银华中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日(基金 合同生效日)至2022年 12月31日
<b>一、营业总收入</b>		19,662,219.07	5,787,542.41
1. 利息收入		55,533.94	105,634.89
其中：存款利息收入	7.4.7.13	55,533.94	105,634.89
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）		12,678,807.16	10,363,724.73
其中：股票投资收益	7.4.7.14	10,432,751.79	10,357,766.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,246,055.37	5,958.00
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	5,367,599.61	-7,691,625.00
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	1,560,278.36	3,009,807.79
<b>减：二、营业总支出</b>		1,161,280.50	368,829.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	803,442.57	307,349.76
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	160,688.48	61,469.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	197,149.45	10.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,500,938.57	5,418,712.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,500,938.57	5,418,712.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,500,938.57	5,418,712.70

### 7.3 净资产变动表

会计主体：银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-171,000,000.0 0	-	6,667,863.20	-164,332,136.80
（一）、综合收益总额	-	-	18,500,938.57	18,500,938.57
（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）	-171,000,000.0 0	-	-11,833,075.37	-182,833,075.37
其中：1. 基金申购款	822,000,000.00	-	21,990,550.48	843,990,550.48
2. 基金赎回款	-993,000,000.0 0	-	-33,823,625.85	-1,026,823,625.85
（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	86,904,091.00	-	-2,165,343.74	84,738,747.26
项目	上年度可比期间			
	2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,250,904,091.00	-	-	1,250,904,091.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-993,000,000.00	-	-8,833,206.94	-1,001,833,206.94
（一）、综合收益总额	-	-	5,418,712.70	5,418,712.70
（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）	-993,000,000.00	-	-14,251,919.64	-1,007,251,919.64
其中：1. 基金申购款	45,000,000.00	-	-787,808.58	44,212,191.42
2. 基金赎回款	-1,038,000,000.00	-	-13,464,111.06	-1,051,464,111.06
（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	257,904,091.00	-	-8,833,206.94	249,070,884.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华中证 1000 增强策略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[2022]2601 号《关于准予银华中证 1000 增强策略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 1000 增强策略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 1,250,861,344.00 元(含募集股票市值),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(2022)第 0951 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2022 年 11 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,250,904,091.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 42,747.00 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2022]1122 号核准,本基金 1,250,904,091.00 份基金份额于 2022 年 12 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华中证 1000 增强策略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。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(含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、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、地方政府债券、政府支持机构债券、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)、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、衍生工具(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。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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》、《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合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度和 2022 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的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 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度和 2022 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年度和 2022 年 11 月 24 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金

成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,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,以及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当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。



### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,803,080.73	7,269,728.25
等于：本金	1,802,827.87	7,269,080.65
加：应计利息	252.86	647.60
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	1,803,080.73	7,269,728.25

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	85,060,684.92	-	82,736,659.53	-2,324,025.39
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	85,060,684.92	-	82,736,659.53	-2,324,025.39

项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	248,690,097.09	-	240,998,472.09	-7,691,625.00
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	248,690,097.09	-	240,998,472.09	-7,691,625.00

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	153,061.48	1,615,766.06
其中：交易所市场	153,061.48	1,615,766.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	195,000.00	-
合计	348,061.48	1,615,766.06

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	257,904,091.00	257,904,091.00
本期申购	822,000,000.00	822,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-993,000,000.00	-993,000,000.00
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	86,904,091.00	86,904,091.00

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,117,162.75	-12,950,369.69	-8,833,206.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,117,162.75	-12,950,369.69	-8,833,206.94
本期利润	13,133,338.96	5,367,599.61	18,500,938.57
本期基金份额交易产生的变动数	-11,773,899.80	-59,175.57	-11,833,075.37
其中：基金申购款	102,893,474.56	-80,902,924.08	21,990,550.48
金赎回款	-114,667,374.36	80,843,748.51	-33,823,625.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,476,601.91	-7,641,945.65	-2,165,343.74

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	22,052.13	98,084.82
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	29,711.51	7,386.29
其他	3,770.30	163.78
合计	55,533.94	105,634.89

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,130,000.17	3,634,748.19
股票投资收益——赎回差价收入	1,302,751.62	6,723,018.54
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	10,432,751.79	10,357,766.73

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,424,982,058.45	554,137,153.17
减：卖出股票成本总额	1,412,974,761.38	548,187,211.07
减：交易费用	2,877,296.90	2,315,193.91
买卖股票差价收入	9,130,000.17	3,634,748.19

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
赎回基金份额对价总额	1,026,823,625.85	1,051,464,111.06
减：现金支付赎回款总额	498,293,710.85	525,959,339.06
减：赎回股票成本总额	527,227,163.38	518,781,753.46
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,302,751.62	6,723,018.54

## 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利 收益	2,246,055.37	5,958.00
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	2,246,055.37	5,958.00

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金 合同生效日）至2022年12月 31日
1. 交易性金融资产	5,367,599.61	-7,691,625.00
股票投资	5,367,599.61	-7,691,625.00



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	5,367,599.61	-7,691,625.00

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,560,278.36	2,993,692.08
其他	-	16,115.71
合计	1,560,278.36	3,009,807.79

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	55,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	270.00	10.00
其他	21,879.45	-
合计	197,149.45	10.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

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

注：1、根据银华基金管理股份有限公司于 2023 年 9 月 27 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会同意，银华基金管理股份有限公司已受让银华长安资本管理（北京）有限公司持有的深圳银华永泰创新投资有限公司全部股权，深圳银华永泰创新投资有限公司已变更为银华基金管理股份有限公司的全资子公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 11 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
西南证券	831,377,450.16	29.79	515,036,037.32	27.91

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
西南证券	364,985.21	26.09	10,597.99	6.92
关联方名称	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
西南证券	376,647.15	23.31	376,647.15	23.31

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合 同生效日）至2022年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	803,442.57	307,349.76
其中：应支付销售机构的客户维护 费	58,778.94	25,161.25
应支付基金管理人的净管理费	744,663.63	282,188.51

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	160,688.48	61,469.95

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至 2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,803,080.73	22,052.13	7,269,728.25	98,084.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	51.05	38.52	310	15,825.50	11,941.20	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	215	11,971.20	8,079.70	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301418	协	2023	6个月	新股	51.88	50.20	167	8,663.96	8,383.40	-

	昌科技	年8月 10日		流通 受限						
301421	波长 光电	2023 年8月 16日	6个月	新股 流通 受限	29.38	59.37	277	8,138.26	16,445.49	-
301468	博盈 特焊	2023 年7月 12日	6个月	新股 流通 受限	47.58	30.22	77	3,663.66	2,326.94	-
301489	思泉 新材	2023 年10 月16 日	6个月	新股 流通 受限	41.66	64.11	64	2,666.24	4,103.04	-
301498	乖宝 宠物	2023 年8月 9日	6个月	新股 流通 受限	39.99	38.81	262	10,477.38	10,168.22	-
301499	维科 精密	2023 年7月 13日	6个月	新股 流通 受限	19.50	28.93	135	2,632.50	3,905.55	-
301505	苏州 规划	2023 年7月 12日	6个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	71	1,870.85	2,542.51	-
301509	金凯 生科	2023 年7月 26日	6个月	新股 流通 受限	56.56	62.23	217	12,273.52	13,503.91	-
301510	固高 科技	2023 年8月 4日	6个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福 科技	2023 年8月 8日	6个月	新股 流通 受限	28.00	22.67	421	11,788.00	9,544.07	-
301515	港通 医疗	2023 年7月 13日	6个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301518	长	2023	6个月	新股	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-

	华化学	年7月 26日		流通 受限						
301550	斯菱股份	2023 年9月 6日	6个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	107	4,018.92	4,661.99	-
301559	中集环科	2023 年9月 26日	6个月	新股 流通 受限	24.22	18.24	166	4,020.52	3,027.84	-
603062	麦加芯彩	2023 年10 月31 日	6个月	新股 流通 受限	58.08	57.81	27	1,568.16	1,560.87	-
603119	浙江荣泰	2023 年7月 21日	6个月	新股 流通 受限	15.32	23.87	211	3,232.52	5,036.57	-
603270	金帝股份	2023 年8月 25日	6个月	新股 流通 受限	21.77	29.58	120	2,612.40	3,549.60	-
603273	天元智能	2023 年10 月16 日	6个月	新股 流通 受限	9.50	18.97	110	1,045.00	2,086.70	-
603296	华勤技术	2023 年8月 1日	6个月	新股 流通 受限	80.80	77.75	147	11,877.60	11,429.25	-
688450	光格科技	2023 年7月 17日	6个月	新股 流通 受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023 年8月 8日	6个月	新股 流通 受限	9.87	12.75	1,278	12,613.86	16,294.50	-
688573	信宇人	2023 年8月 9日	6个月	新股 流通 受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688591	泰凌	2023 年8月	6个月	新股 流通	24.98	28.02	344	8,593.12	9,638.88	-

	微	18 日		受限						
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.33	51.00	53	3,886.49	2,703.00	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	48	2,244.96	4,210.56	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	31	3,205.40	2,425.13	-
688671	碧兴物联	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023 年 12 月 26 日	重大事项停牌	8.48	2024 年 1 月 10 日	9.33	5,600	53,153.48	47,488.00	-



688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年1月9日	41.72	196	8,606.07	8,598.52	-
--------	------	-------------	--------	-------	-----------	-------	-----	----------	----------	---

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	1,803,080.73	-	-	-	1,803,080.73
结算备付金	469,578.46	-	-	-	469,578.46
存出保证金	121,201.22	-	-	-	121,201.22
交易性金融资产	-	-	-	82,736,659.53	82,736,659.53
资产总计	2,393,860.41	-	-	82,736,659.53	85,130,519.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,425.99	36,425.99
应付托管费	-	-	-	7,285.21	7,285.21
其他负债	-	-	-	348,061.48	348,061.48
负债总计	-	-	-	391,772.68	391,772.68
利率敏感度缺口	2,393,860.41	-	-	82,344,886.85	84,738,747.26
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,269,728.25	-	-	-	7,269,728.25
结算备付金	5,467,740.66	-	-	-	5,467,740.66
存出保证金	121,365.22	-	-	-	121,365.22
交易性金融资产	-	-	-	240,998,472.09	240,998,472.09
应收清算款	-	-	-	1,350,488.40	1,350,488.40
资产总计	12,858,834.13	-	-	242,348,960.49	255,207,794.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	204,484.83	204,484.83
应付托管费	-	-	-	40,896.97	40,896.97
应付清算款	-	-	-	4,275,762.70	4,275,762.70
其他负债	-	-	-	1,615,766.06	1,615,766.06
负债总计	-	-	-	6,136,910.56	6,136,910.56
利率敏感度缺口	12,858,834.13	-	-	236,212,049.93	249,070,884.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末（上期末）持有的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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	82,736,659.53	97.64	240,998,472.09	96.76
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	82,736,659.53	97.64	240,998,472.09	96.76

#### 7.4.13.4.3.2 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%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	3,805,662.67	8,672,705.32
	业绩比较基准下降	-3,805,662.67	-8,672,705.32

	5%		
--	----	--	--

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	82,407,742.09	240,998,472.09
第二层次	56,086.52	-
第三层次	272,830.92	-
合计	82,736,659.53	240,998,472.09

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	239,365.40	239,365.40
转出第三层次	-	2,209.62	2,209.62
当期利得或损失总额	-	35,675.14	35,675.14
其中：计入损益的利得或损失	-	35,675.14	35,675.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	272,830.92	272,830.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,838.52	35,838.52
项目	上年度可比期间 2022年11月24日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金购买第三层次交易性金融资产及第三层次转入/转出的交易性金融资产均为限售股票投资及限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	272,830.92	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本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。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,736,659.53	97.19
	其中：股票	82,736,659.53	97.19
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	2,272,659.19	2.67
8	其他各项资产	121,201.22	0.14

9	合计	85,130,519.94	100.00
---	----	---------------	--------

注：股票投资含可退替代款估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	228,122.00	0.27
B	采矿业	2,868,886.00	3.39
C	制造业	46,377,151.62	54.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,868,771.40	2.21
E	建筑业	1,561,873.00	1.84
F	批发和零售业	1,578,371.30	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,714,675.00	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,932,260.23	10.54
J	金融业	772,714.00	0.91
K	房地产业	1,572,158.00	1.86
L	租赁和商务服务业	559,012.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	390,098.45	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	717,580.60	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	470,228.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	1,269,108.70	1.50
S	综合	26,023.00	0.03
	合计	70,907,033.30	83.68

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	111,186.00	0.13
B	采矿业	266,906.00	0.31
C	制造业	7,734,348.90	9.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	232,300.00	0.27



E	建筑业	209,251.00	0.25
F	批发和零售业	313,960.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	141,746.00	0.17
H	住宿和餐饮业	49,344.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	572,736.35	0.68
J	金融业	42,456.00	0.05
K	房地产业	798,959.00	0.94
L	租赁和商务服务业	160,921.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	350,241.81	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	208,342.17	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	102,997.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	533,931.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	11,829,626.23	13.96

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002130	沃尔核材	96,900	731,595.00	0.86
2	002645	华宏科技	62,700	708,510.00	0.84
3	300382	斯莱克	64,300	638,499.00	0.75
4	002212	天融信	57,400	561,372.00	0.66
5	002085	万丰奥威	113,500	560,690.00	0.66
6	002421	达实智能	172,700	556,094.00	0.66
7	002283	天润工业	87,100	509,535.00	0.60
8	002649	博彦科技	40,600	498,162.00	0.59
9	688106	金宏气体	20,404	491,532.36	0.58
10	603989	艾华集团	22,700	488,504.00	0.58
11	601801	皖新传媒	68,600	476,770.00	0.56

12	603920	世运电路	25,000	457,000.00	0.54
13	600643	爱建集团	87,800	447,780.00	0.53
14	300143	盈康生命	41,300	439,019.00	0.52
15	600037	歌华有线	56,600	437,518.00	0.52
16	300323	华灿光电	55,800	408,456.00	0.48
17	603530	神马电力	19,600	406,504.00	0.48
18	000951	中国重汽	30,200	403,472.00	0.48
19	603236	移远通信	7,500	403,125.00	0.48
20	600502	安徽建工	86,600	402,690.00	0.48
21	600266	城建发展	81,400	393,976.00	0.46
22	601918	新集能源	74,100	390,507.00	0.46
23	000902	新洋丰	33,500	381,565.00	0.45
24	300679	电连技术	9,100	377,650.00	0.45
25	002498	汉缆股份	94,300	377,200.00	0.45
26	002214	大立科技	32,700	375,069.00	0.44
27	603328	依顿电子	46,000	374,900.00	0.44
28	688209	英集芯	20,975	374,613.50	0.44
29	000737	北方铜业	64,400	373,520.00	0.44
30	300768	迪普科技	24,900	368,022.00	0.43
31	000032	深桑达 A	17,200	364,296.00	0.43
32	300151	昌红科技	19,600	360,248.00	0.43
33	300767	震安科技	20,500	356,290.00	0.42
34	002773	康弘药业	19,200	354,048.00	0.42
35	002635	安洁科技	21,300	347,829.00	0.41
36	000543	皖能电力	55,400	346,804.00	0.41
37	600562	国睿科技	25,000	346,000.00	0.41
38	600483	福能股份	41,220	340,889.40	0.40
39	600997	开滦股份	44,500	339,535.00	0.40
40	002747	埃斯顿	18,200	338,338.00	0.40
41	000555	神州信息	29,700	335,313.00	0.40
42	603678	火炬电子	12,500	330,875.00	0.39
43	688139	海尔生物	8,159	330,602.68	0.39
44	600872	中炬高新	11,700	328,770.00	0.39
45	000810	创维数字	20,900	328,339.00	0.39
46	600750	江中药业	15,700	327,816.00	0.39
47	002396	星网锐捷	18,100	327,067.00	0.39
48	601369	陕鼓动力	40,600	323,988.00	0.38
49	603171	税友股份	9,100	321,958.00	0.38
50	601567	三星医疗	15,700	321,850.00	0.38
51	603393	新天然气	10,500	320,985.00	0.38
52	603876	鼎胜新材	25,600	320,768.00	0.38
53	002567	唐人神	42,300	317,250.00	0.37
54	002258	利尔化学	26,500	317,205.00	0.37

55	603979	金诚信	8,400	317,184.00	0.37
56	601101	昊华能源	50,100	316,632.00	0.37
57	000650	仁和药业	46,900	310,947.00	0.37
58	300369	绿盟科技	32,900	310,247.00	0.37
59	002390	信邦制药	69,400	308,136.00	0.36
60	600812	华北制药	53,300	303,810.00	0.36
61	300627	华测导航	9,700	300,894.00	0.36
62	001696	宗申动力	45,200	299,676.00	0.35
63	000061	农产品	46,000	297,620.00	0.35
64	600125	铁龙物流	48,800	295,240.00	0.35
65	603718	海利生物	27,400	293,454.00	0.35
66	600395	盘江股份	47,300	291,841.00	0.34
67	300183	东软载波	19,300	291,237.00	0.34
68	002516	旷达科技	58,600	288,898.00	0.34
69	603298	杭叉集团	11,600	288,608.00	0.34
70	601609	金田股份	42,500	287,725.00	0.34
71	000688	国城矿业	27,900	287,649.00	0.34
72	300327	中颖电子	12,600	287,280.00	0.34
73	688232	新点软件	7,927	286,957.40	0.34
74	000990	诚志股份	34,900	286,529.00	0.34
75	300348	长亮科技	27,700	285,587.00	0.34
76	000528	柳工	42,100	283,754.00	0.33
77	002274	华昌化工	37,100	280,105.00	0.33
78	600331	宏达股份	54,300	278,559.00	0.33
79	002063	远光软件	44,620	275,751.60	0.33
80	688707	振华新材	13,426	275,233.00	0.32
81	601702	华峰铝业	15,300	274,635.00	0.32
82	600012	皖通高速	24,900	274,398.00	0.32
83	600933	爱柯迪	12,500	274,250.00	0.32
84	600618	氯碱化工	30,100	273,910.00	0.32
85	603113	金能科技	33,900	273,573.00	0.32
86	000969	安泰科技	30,400	273,296.00	0.32
87	601019	山东出版	29,100	272,958.00	0.32
88	002091	江苏国泰	34,700	271,701.00	0.32
89	600610	中毅达	28,900	271,371.00	0.32
90	300685	艾德生物	12,300	270,354.00	0.32
91	002891	中宠股份	10,200	268,770.00	0.32
92	002003	伟星股份	24,700	267,995.00	0.32
93	600201	生物股份	24,800	267,096.00	0.32
94	000685	中山公用	36,500	266,815.00	0.31
95	300639	凯普生物	28,400	265,256.00	0.31
96	002217	合力泰	96,500	262,480.00	0.31
97	600691	阳煤化工	81,500	261,615.00	0.31

98	600312	平高电气	20,400	258,876.00	0.31
99	002488	金固股份	35,900	257,762.00	0.30
100	002171	楚江新材	34,400	257,312.00	0.30
101	603010	万盛股份	23,700	255,723.00	0.30
102	300035	中科电气	24,100	254,014.00	0.30
103	300702	天宇股份	11,700	254,007.00	0.30
104	600966	博汇纸业	40,600	252,126.00	0.30
105	688100	威胜信息	8,689	251,285.88	0.30
106	002318	久立特材	12,600	250,488.00	0.30
107	601886	江河集团	37,600	250,416.00	0.30
108	600446	金证股份	21,600	249,912.00	0.29
109	000088	盐田港	51,100	249,368.00	0.29
110	301200	大族数控	6,600	249,282.00	0.29
111	000811	冰轮环境	18,300	248,331.00	0.29
112	301015	百洋医药	6,900	247,434.00	0.29
113	688321	微芯生物	11,234	246,586.30	0.29
114	600007	中国国贸	12,700	246,126.00	0.29
115	003012	东鹏控股	29,700	245,025.00	0.29
116	002646	天佑德酒	18,000	244,980.00	0.29
117	000818	航锦科技	7,800	244,764.00	0.29
118	688366	昊海生科	2,257	244,410.53	0.29
119	600216	浙江医药	22,600	242,498.00	0.29
120	603871	嘉友国际	15,200	241,072.00	0.28
121	300203	聚光科技	15,200	240,920.00	0.28
122	300267	尔康制药	74,100	237,861.00	0.28
123	601200	上海环境	26,400	237,336.00	0.28
124	688206	概伦电子	10,843	236,377.40	0.28
125	002544	普天科技	11,600	235,712.00	0.28
126	600675	中华企业	74,700	235,305.00	0.28
127	688083	中望软件	2,355	234,416.70	0.28
128	002221	东华能源	22,600	232,780.00	0.27
129	600252	中恒集团	92,000	230,920.00	0.27
130	002724	海洋王	27,800	228,516.00	0.27
131	600123	兰花科创	20,600	227,424.00	0.27
132	688739	成大生物	6,990	227,244.90	0.27
133	300002	神州泰岳	25,600	226,560.00	0.27
134	688173	希荻微	12,874	226,453.66	0.27
135	600557	康缘药业	11,000	225,720.00	0.27
136	002215	诺普信	27,100	223,846.00	0.26
137	300860	锋尚文化	4,090	223,436.70	0.26
138	603055	台华新材	18,500	222,740.00	0.26
139	301327	华宝新能	2,900	221,560.00	0.26
140	002043	兔宝宝	25,000	221,500.00	0.26

141	601908	京运通	48,400	221,188.00	0.26
142	002190	成飞集成	11,600	220,052.00	0.26
143	000597	东北制药	41,100	219,885.00	0.26
144	600338	西藏珠峰	17,900	217,664.00	0.26
145	688128	中国电研	10,565	216,793.80	0.26
146	002099	海翔药业	30,000	215,700.00	0.25
147	300377	赢时胜	27,500	213,400.00	0.25
148	000791	甘肃能源	37,800	210,546.00	0.25
149	000048	京基智农	11,500	210,450.00	0.25
150	600478	科力远	42,400	208,608.00	0.25
151	300735	光弘科技	8,800	207,152.00	0.24
152	301177	迪阿股份	7,000	206,430.00	0.24
153	000968	蓝焰控股	29,000	206,190.00	0.24
154	300343	联创股份	31,100	205,260.00	0.24
155	600986	浙文互联	37,400	204,204.00	0.24
156	688368	晶丰明源	1,877	202,603.38	0.24
157	301217	铜冠铜箔	17,000	201,620.00	0.24
158	002088	鲁阳节能	14,100	200,925.00	0.24
159	000795	英洛华	32,200	200,606.00	0.24
160	300027	华谊兄弟	73,500	196,980.00	0.23
161	300821	东岳硅材	23,700	196,710.00	0.23
162	300077	国民技术	17,400	196,446.00	0.23
163	603301	振德医疗	7,900	193,550.00	0.23
164	000672	上峰水泥	24,000	193,440.00	0.23
165	301175	中科环保	38,700	193,113.00	0.23
166	002068	黑猫股份	16,500	191,400.00	0.23
167	600882	妙可蓝多	11,700	188,019.00	0.22
168	688088	虹软科技	4,576	187,799.04	0.22
169	000901	航天科技	20,100	187,332.00	0.22
170	002489	浙江永强	60,900	185,136.00	0.22
171	001338	永顺泰	15,300	184,518.00	0.22
172	000426	兴业银锡	20,300	184,324.00	0.22
173	600688	上海石化	63,300	181,038.00	0.21
174	300662	科锐国际	6,500	179,530.00	0.21
175	300738	奥飞数据	16,900	178,971.00	0.21
176	000090	天健集团	38,900	178,940.00	0.21
177	003006	百亚股份	11,800	178,888.00	0.21
178	002139	拓邦股份	18,300	178,608.00	0.21
179	002332	仙琚制药	13,900	177,503.00	0.21
180	603766	隆鑫通用	34,200	176,472.00	0.21
181	002946	新乳业	15,300	175,644.00	0.21
182	300737	科顺股份	28,400	174,376.00	0.21
183	600510	黑牡丹	30,200	170,630.00	0.20

184	002182	宝武镁业	8,600	169,076.00	0.20
185	002126	银轮股份	9,000	168,030.00	0.20
186	300451	创业慧康	24,950	163,422.50	0.19
187	300653	正海生物	5,600	162,512.00	0.19
188	603599	广信股份	11,200	162,400.00	0.19
189	600797	浙大网新	24,700	162,032.00	0.19
190	300271	华宇软件	19,700	161,343.00	0.19
191	000035	中国天楹	32,600	161,044.00	0.19
192	300761	立华股份	7,600	159,372.00	0.19
193	000557	西部创业	32,800	158,424.00	0.19
194	002950	奥美医疗	16,600	157,368.00	0.19
195	603129	春风动力	1,500	153,360.00	0.18
196	600273	嘉化能源	17,800	152,902.00	0.18
197	002335	科华数据	5,500	152,240.00	0.18
198	601137	博威合金	9,700	150,641.00	0.18
199	000761	本钢板材	41,800	149,226.00	0.18
200	688023	安恒信息	1,274	141,273.86	0.17
201	000927	中国铁物	52,400	139,908.00	0.17
202	603297	永新光学	1,400	139,090.00	0.16
203	600971	恒源煤电	12,400	138,260.00	0.16
204	688235	百济神州	990	137,649.60	0.16
205	601882	海天精工	5,100	133,365.00	0.16
206	300803	指南针	2,200	132,572.00	0.16
207	605376	博迁新材	4,700	132,540.00	0.16
208	600284	浦东建设	20,900	131,670.00	0.16
209	300401	花园生物	11,000	129,910.00	0.15
210	600017	日照港	46,800	128,700.00	0.15
211	000567	海德股份	11,700	124,371.00	0.15
212	300034	钢研高纳	6,100	124,135.00	0.15
213	603983	丸美股份	4,900	123,823.00	0.15
214	001322	箭牌家居	10,400	123,344.00	0.15
215	300232	洲明科技	14,000	123,200.00	0.15
216	300777	中简科技	4,100	122,303.00	0.14
217	000498	山东路桥	21,500	121,260.00	0.14
218	002484	江海股份	7,500	120,450.00	0.14
219	000059	华锦股份	21,900	120,231.00	0.14
220	000921	海信家电	5,891	120,176.40	0.14
221	300352	北信源	24,900	118,275.00	0.14
222	600098	广州发展	21,800	117,066.00	0.14
223	002434	万里扬	15,700	116,965.00	0.14
224	600363	联创光电	3,400	115,600.00	0.14
225	603995	甬金股份	6,000	115,380.00	0.14
226	300497	富祥药业	12,200	114,192.00	0.13

227	300762	上海瀚讯	7,400	111,592.00	0.13
228	300080	易成新能	23,000	111,320.00	0.13
229	300638	广和通	5,800	110,374.00	0.13
230	002583	海能达	18,400	109,480.00	0.13
231	600572	康恩贝	21,600	109,080.00	0.13
232	601606	长城军工	8,800	107,184.00	0.13
233	300973	立高食品	2,200	106,810.00	0.13
234	600458	时代新材	11,500	105,915.00	0.12
235	603906	龙蟠科技	8,500	105,910.00	0.12
236	300236	上海新阳	3,000	105,660.00	0.12
237	300416	苏试试验	5,700	104,709.00	0.12
238	601677	明泰铝业	9,200	104,328.00	0.12
239	002727	一心堂	4,400	101,904.00	0.12
240	600633	浙数文化	8,400	92,904.00	0.11
241	300894	火星号	5,700	92,568.00	0.11
242	688033	天宜上佳	5,213	88,099.70	0.10
243	002314	南山控股	30,100	87,290.00	0.10
244	600649	城投控股	23,500	86,950.00	0.10
245	300409	道氏技术	7,700	85,778.00	0.10
246	600710	苏美达	11,900	84,371.00	0.10
247	603466	风语筑	5,800	83,404.00	0.10
248	600057	厦门象屿	12,200	81,862.00	0.10
249	600645	中源协和	4,000	81,080.00	0.10
250	000016	深康佳 A	19,300	80,481.00	0.09
251	002402	和而泰	5,600	80,024.00	0.09
252	688266	泽璟制药	1,503	79,568.82	0.09
253	002174	游族网络	6,900	79,074.00	0.09
254	000989	九芝堂	7,700	77,924.00	0.09
255	688568	中科星图	1,588	77,907.28	0.09
256	002100	天康生物	8,800	77,176.00	0.09
257	601212	白银有色	28,600	76,934.00	0.09
258	600711	盛屯矿业	17,600	76,384.00	0.09
259	002978	安宁股份	2,400	75,984.00	0.09
260	688262	国芯科技	2,527	74,142.18	0.09
261	300303	聚飞光电	12,500	74,125.00	0.09
262	300463	迈克生物	4,900	73,843.00	0.09
263	600496	精工钢构	24,200	73,810.00	0.09
264	603187	海容冷链	4,840	73,374.40	0.09
265	002206	海利得	14,500	72,790.00	0.09
266	002436	兴森科技	4,900	72,177.00	0.09
267	688388	嘉元科技	3,546	71,912.88	0.08
268	600552	凯盛科技	5,300	70,649.00	0.08
269	600055	万东医疗	4,100	70,028.00	0.08

270	600063	皖维高新	16,200	69,660.00	0.08
271	688680	海优新材	1,056	69,326.40	0.08
272	600612	老凤祥	1,000	69,000.00	0.08
273	000682	东方电子	8,500	68,425.00	0.08
274	301087	可孚医疗	1,800	68,220.00	0.08
275	688586	江航装备	6,141	68,103.69	0.08
276	600773	西藏城投	6,200	67,952.00	0.08
277	002440	闰土股份	11,100	67,710.00	0.08
278	603915	国茂股份	4,100	67,568.00	0.08
279	688018	乐鑫科技	656	67,535.20	0.08
280	300188	国投智能	4,200	67,284.00	0.08
281	300031	宝通科技	3,600	66,744.00	0.08
282	600490	鹏欣资源	22,300	66,677.00	0.08
283	002840	华统股份	3,200	66,528.00	0.08
284	600810	神马股份	8,900	66,216.00	0.08
285	688238	和元生物	7,353	66,103.47	0.08
286	600059	古越龙山	7,100	66,030.00	0.08
287	002011	盾安环境	4,800	66,000.00	0.08
288	603348	文灿股份	1,700	65,960.00	0.08
289	600604	市北高新	14,200	65,746.00	0.08
290	002737	葵花药业	2,500	64,950.00	0.08
291	600587	新华医疗	2,500	64,475.00	0.08
292	002053	云南能投	6,700	64,454.00	0.08
293	002254	泰和新材	4,300	64,328.00	0.08
294	688127	蓝特光学	2,751	64,070.79	0.08
295	300229	拓尔思	3,800	64,068.00	0.08
296	600073	上海梅林	9,400	64,014.00	0.08
297	002585	双星新材	7,800	63,258.00	0.07
298	688800	瑞可达	1,563	62,801.34	0.07
299	300226	上海钢联	2,200	62,678.00	0.07
300	300696	爱乐达	3,600	62,676.00	0.07
301	601975	招商南油	22,300	62,440.00	0.07
302	300596	利安隆	2,100	62,076.00	0.07
303	300841	康华生物	800	62,032.00	0.07
304	300770	新媒股份	1,600	61,888.00	0.07
305	000736	中交地产	6,300	61,677.00	0.07
306	002726	龙大美食	7,600	61,560.00	0.07
307	300206	理邦仪器	6,000	61,260.00	0.07
308	000028	国药一致	2,070	60,009.30	0.07
309	002605	姚记科技	2,700	59,994.00	0.07
310	000758	中色股份	13,300	59,850.00	0.07
311	600320	振华重工	18,000	59,760.00	0.07
312	000860	顺鑫农业	2,800	59,612.00	0.07



313	300666	江丰电子	1,000	58,580.00	0.07
314	600211	西藏药业	1,200	58,560.00	0.07
315	603713	密尔克卫	1,100	58,531.00	0.07
316	600480	凌云股份	6,400	58,304.00	0.07
317	300593	新雷能	3,940	58,193.80	0.07
318	000950	重药控股	11,700	58,149.00	0.07
319	000690	宝新能源	13,100	58,033.00	0.07
320	002556	辉隆股份	9,800	57,624.00	0.07
321	605020	永和股份	2,300	57,523.00	0.07
322	600248	陕建股份	14,300	57,486.00	0.07
323	600955	维远股份	3,200	57,440.00	0.07
324	600223	福瑞达	5,900	56,817.00	0.07
325	301035	润丰股份	800	56,000.00	0.07
326	300284	苏交科	10,200	55,590.00	0.07
327	603396	金辰股份	1,000	54,650.00	0.06
328	000403	派林生物	2,000	54,480.00	0.06
329	000885	城发环境	4,800	54,432.00	0.06
330	600850	电科数字	2,500	54,375.00	0.06
331	601619	嘉泽新能	15,400	54,362.00	0.06
332	300726	宏达电子	1,800	54,342.00	0.06
333	000049	德赛电池	2,000	54,240.00	0.06
334	300294	博雅生物	1,600	53,888.00	0.06
335	300398	飞凯材料	3,400	53,584.00	0.06
336	002158	汉钟精机	2,400	53,424.00	0.06
337	600821	金开新能	8,700	53,244.00	0.06
338	688798	艾为电子	771	53,222.13	0.06
339	002276	万马股份	5,200	53,144.00	0.06
340	301039	中集车辆	5,600	52,528.00	0.06
341	002573	清新环境	10,600	52,470.00	0.06
342	603612	索通发展	3,400	52,326.00	0.06
343	600662	外服控股	10,800	51,840.00	0.06
344	688518	联赢激光	2,511	51,425.28	0.06
345	002928	华夏航空	7,200	51,408.00	0.06
346	002967	广电计量	3,400	51,034.00	0.06
347	600761	安徽合力	2,800	50,988.00	0.06
348	002932	明德生物	2,200	50,534.00	0.06
349	002006	精工科技	3,300	50,424.00	0.06
350	000917	电广传媒	9,200	50,416.00	0.06
351	603308	应流股份	3,500	50,155.00	0.06
352	688686	奥普特	445	49,840.00	0.06
353	600578	京能电力	16,800	49,728.00	0.06
354	605507	国邦医药	2,800	49,168.00	0.06
355	603588	高能环境	7,440	48,657.60	0.06

356	000488	晨鸣纸业	12,500	48,500.00	0.06
357	688381	帝奥微	1,907	48,285.24	0.06
358	600729	重庆百货	1,700	47,940.00	0.06
359	002545	东方铁塔	6,700	47,905.00	0.06
360	000550	江铃汽车	2,500	47,575.00	0.06
361	603566	普莱柯	2,100	47,565.00	0.06
362	000657	中钨高新	5,600	47,488.00	0.06
363	300185	通裕重工	19,500	46,800.00	0.06
364	600389	江山股份	2,600	45,240.00	0.05
365	000735	罗牛山	7,700	44,429.00	0.05
366	688403	汇成股份	4,186	44,162.30	0.05
367	301078	孩子王	5,300	43,513.00	0.05
368	600064	南京高科	7,100	42,884.00	0.05
369	603063	禾望电气	1,700	42,500.00	0.05
370	603281	江瀚新材	1,600	42,064.00	0.05
371	301071	力量钻石	1,300	41,990.00	0.05
372	000913	钱江摩托	3,300	41,151.00	0.05
373	600635	大众公用	13,500	40,770.00	0.05
374	601001	晋控煤业	3,300	40,689.00	0.05
375	603936	博敏电子	3,800	39,672.00	0.05
376	603043	广州酒家	2,000	39,060.00	0.05
377	603100	川仪股份	1,400	38,808.00	0.05
378	603132	金徽股份	2,800	38,304.00	0.05
379	002467	二六三	8,200	38,048.00	0.04
380	600151	航天机电	5,700	37,563.00	0.04
381	300171	东富龙	2,000	35,980.00	0.04
382	600179	安通控股	14,300	35,750.00	0.04
383	300065	海兰信	3,500	35,595.00	0.04
384	002990	盛视科技	1,000	34,530.00	0.04
385	603881	数据港	1,700	33,694.00	0.04
386	688508	芯朋微	683	33,610.43	0.04
387	300119	瑞普生物	2,000	32,780.00	0.04
388	300587	天铁股份	5,600	32,704.00	0.04
389	300068	南都电源	2,500	32,350.00	0.04
390	600996	贵广网络	3,500	31,360.00	0.04
391	601222	林洋能源	4,900	31,311.00	0.04
392	002219	新里程	10,300	31,209.00	0.04
393	300208	青岛中程	4,600	30,728.00	0.04
394	600459	贵研铂业	2,129	30,572.44	0.04
395	688660	电气风电	5,912	30,387.68	0.04
396	002987	京北方	1,600	29,728.00	0.04
397	300613	富瀚微	700	29,708.00	0.04
398	600072	中船科技	1,600	29,664.00	0.04

399	300476	胜宏科技	1,600	29,520.00	0.03
400	000030	富奥股份	5,500	29,370.00	0.03
401	600477	杭萧钢构	8,900	29,281.00	0.03
402	688066	航天宏图	690	29,145.60	0.03
403	300671	富满微	900	29,097.00	0.03
404	603556	海兴电力	1,000	29,030.00	0.03
405	002746	仙坛股份	4,100	28,864.00	0.03
406	603093	南华期货	2,300	27,600.00	0.03
407	603609	禾丰股份	3,200	27,392.00	0.03
408	600110	诺德股份	4,800	27,072.00	0.03
409	688161	威高骨科	648	26,859.60	0.03
410	600770	综艺股份	5,300	26,023.00	0.03
411	000420	吉林化纤	8,600	25,026.00	0.03
412	600475	华光环能	2,400	24,960.00	0.03
413	300170	汉得信息	3,000	24,930.00	0.03
414	600120	浙江东方	6,900	24,771.00	0.03
415	002287	奇正藏药	1,100	24,739.00	0.03
416	000789	万年青	3,600	24,696.00	0.03
417	000881	中广核技	3,400	24,650.00	0.03
418	001323	慕思股份	800	24,400.00	0.03
419	301367	怡和嘉业	200	24,350.00	0.03
420	002124	天邦食品	6,700	24,321.00	0.03
421	000029	深深房 A	2,000	23,520.00	0.03
422	603567	珍宝岛	1,900	23,104.00	0.03
423	600210	紫江企业	4,900	23,030.00	0.03
424	002651	利君股份	3,300	22,836.00	0.03
425	688696	极米科技	200	22,596.00	0.03
426	600835	上海机电	1,900	22,553.00	0.03
427	002859	洁美科技	900	22,455.00	0.03
428	000718	苏宁环球	8,500	22,015.00	0.03
429	688298	东方生物	614	21,956.64	0.03
430	600577	精达股份	5,300	21,942.00	0.03
431	300319	麦捷科技	2,200	21,208.00	0.03
432	002135	东南网架	3,600	20,808.00	0.02
433	300079	数码视讯	3,600	20,484.00	0.02
434	300772	运达股份	1,852	19,705.28	0.02
435	688261	东微半导	234	19,560.06	0.02
436	600391	航发科技	1,000	19,120.00	0.02
437	601068	中铝国际	4,100	18,942.00	0.02
438	601208	东材科技	1,500	18,570.00	0.02
439	002706	良信股份	2,100	18,543.00	0.02
440	002048	宁波华翔	1,400	18,214.00	0.02
441	601965	中国汽研	800	17,648.00	0.02

442	600428	中远海特	3,200	17,152.00	0.02
443	002324	普利特	1,300	17,095.00	0.02
444	603197	保隆科技	300	16,920.00	0.02
445	002218	拓日新能	3,700	16,687.00	0.02
446	600169	太原重工	7,000	16,520.00	0.02
447	603105	芯能科技	1,400	16,212.00	0.02
448	000582	北部湾港	2,100	15,771.00	0.02
449	000627	天茂集团	5,500	15,620.00	0.02
450	600158	中体产业	2,000	15,560.00	0.02
451	002537	海联金汇	2,300	15,318.00	0.02
452	600531	豫光金铅	2,500	15,125.00	0.02
453	300109	新开源	800	14,432.00	0.02
454	002991	甘源食品	200	14,292.00	0.02
455	001308	康冠科技	500	13,990.00	0.02
456	600400	红豆股份	5,000	13,950.00	0.02
457	688315	诺禾致源	597	13,933.98	0.02
458	605589	圣泉集团	600	13,428.00	0.02
459	002581	未名医药	900	13,140.00	0.02
460	300623	捷捷微电	800	12,696.00	0.01
461	002461	珠江啤酒	1,600	12,640.00	0.01
462	300856	科思股份	200	12,446.00	0.01
463	600717	天津港	2,900	11,919.00	0.01
464	002023	海特高新	1,300	11,830.00	0.01
465	000517	荣安地产	4,600	11,270.00	0.01
466	002698	博实股份	700	10,633.00	0.01
467	000019	深粮控股	1,400	10,556.00	0.01
468	002539	云图控股	1,200	9,900.00	0.01
469	301090	华润材料	900	9,774.00	0.01
470	002302	西部建设	1,500	9,720.00	0.01
471	002267	陕天然气	1,300	9,529.00	0.01
472	002416	爱施德	1,000	9,290.00	0.01
473	002701	奥瑞金	2,200	9,108.00	0.01
474	688499	利元亨	237	9,024.96	0.01
475	688337	普源精电	196	8,598.52	0.01
476	002097	山河智能	1,400	8,582.00	0.01
477	002768	国恩股份	400	8,568.00	0.01
478	603565	中谷物流	1,000	8,230.00	0.01
479	002004	华邦健康	1,700	7,922.00	0.01
480	688617	惠泰医疗	20	7,770.00	0.01
481	002815	崇达技术	800	7,664.00	0.01
482	002534	西子洁能	600	7,494.00	0.01
483	002125	湘潭电化	700	7,483.00	0.01
484	688389	普门科技	303	6,820.53	0.01

485	000062	深圳华强	600	6,762.00	0.01
486	601399	国机重装	2,300	6,509.00	0.01
487	002242	九阳股份	500	6,355.00	0.01
488	300527	中船应急	800	6,096.00	0.01
489	002741	光华科技	400	5,948.00	0.01
490	603169	兰石重装	700	4,312.00	0.01
491	600696	岩石股份	200	3,598.00	0.00
492	300039	上海凯宝	500	3,325.00	0.00
493	002108	沧州明珠	700	2,877.00	0.00
494	688711	宏微科技	31	1,286.19	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688265	南模生物	5,274	202,785.30	0.24
2	601138	工业富联	12,300	185,976.00	0.22
3	300709	精研科技	5,800	180,902.00	0.21
4	600325	华发股份	24,900	179,529.00	0.21
5	603233	大参林	7,200	179,280.00	0.21
6	688353	华盛锂电	6,399	175,332.60	0.21
7	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.20
8	688175	高凌信息	6,115	170,791.95	0.20
9	601928	凤凰传媒	18,600	163,866.00	0.19
10	300454	深信服	2,200	159,038.00	0.19
11	600582	天地科技	24,200	131,648.00	0.16
12	000423	东阿阿胶	2,400	118,368.00	0.14
13	000100	TCL 科技	27,300	117,390.00	0.14
14	002475	立讯精密	3,400	117,130.00	0.14
15	300389	艾比森	6,700	116,178.00	0.14
16	000425	徐工机械	21,000	114,660.00	0.14
17	300750	宁德时代	700	114,282.00	0.13
18	002334	英威腾	12,900	112,617.00	0.13
19	002129	TCL 中环	7,200	112,608.00	0.13
20	601615	明阳智能	8,900	111,606.00	0.13
21	002714	牧原股份	2,700	111,186.00	0.13
22	300415	伊之密	6,300	111,069.00	0.13
23	301029	怡合达	4,300	110,854.00	0.13
24	600425	青松建化	28,000	110,600.00	0.13
25	300740	水羊股份	6,600	110,022.00	0.13
26	002027	分众传媒	17,200	108,704.00	0.13
27	600011	华能国际	14,100	108,570.00	0.13
28	300003	乐普医疗	6,700	108,272.00	0.13
29	600215	派斯林	12,600	107,604.00	0.13

30	688425	铁建重工	27,060	107,428.20	0.13
31	600987	航民股份	12,100	105,996.00	0.13
32	000733	振华科技	1,800	105,912.00	0.12
33	001979	招商蛇口	11,100	105,783.00	0.12
34	002353	杰瑞股份	3,700	104,007.00	0.12
35	600048	保利发展	10,500	103,950.00	0.12
36	000516	国际医学	12,700	102,997.00	0.12
37	300580	贝斯特	3,400	102,952.00	0.12
38	600256	广汇能源	14,300	102,102.00	0.12
39	300258	精锻科技	7,900	102,068.00	0.12
40	600383	金地集团	23,000	100,280.00	0.12
41	002244	滨江集团	13,600	98,872.00	0.12
42	600388	龙净环保	7,700	98,483.00	0.12
43	603018	华设集团	12,800	97,280.00	0.11
44	300893	松原股份	3,300	96,459.00	0.11
45	300591	万里马	15,900	96,195.00	0.11
46	002938	鹏鼎控股	4,300	95,976.00	0.11
47	601186	中国铁建	12,600	95,886.00	0.11
48	688269	凯立新材	2,557	94,634.57	0.11
49	300251	光线传媒	11,500	93,725.00	0.11
50	601098	中南传媒	9,100	92,547.00	0.11
51	600757	长江传媒	12,300	91,635.00	0.11
52	603758	秦安股份	8,000	91,520.00	0.11
53	300815	玉禾田	6,200	90,520.00	0.11
54	300760	迈瑞医疗	300	87,180.00	0.10
55	000725	京东方 A	22,000	85,800.00	0.10
56	688165	埃夫特	7,270	83,314.20	0.10
57	600469	风神股份	13,100	80,827.00	0.10
58	605358	立昂微	2,900	79,431.00	0.09
59	600376	首开股份	26,000	79,040.00	0.09
60	002723	小崧股份	7,300	74,679.00	0.09
61	688103	国力股份	1,414	69,823.32	0.08
62	600489	中金黄金	6,900	68,724.00	0.08
63	688382	益方生物	4,181	63,300.34	0.07
64	002397	梦洁股份	14,900	61,686.00	0.07
65	688480	赛恩斯	1,554	60,170.88	0.07
66	603977	国泰集团	5,700	59,280.00	0.07
67	300132	青松股份	11,200	58,464.00	0.07
68	301070	开勒股份	1,300	58,318.00	0.07
69	300396	迪瑞医疗	1,900	55,955.00	0.07
70	688426	康为世纪	1,818	55,539.90	0.07
71	300849	锦盛新材	4,100	54,284.00	0.06
72	688628	优利德	1,366	53,820.40	0.06

73	300529	健帆生物	2,400	53,352.00	0.06
74	001215	千味央厨	1,000	52,810.00	0.06
75	002738	中矿资源	1,400	52,234.00	0.06
76	688148	芳源股份	6,748	51,757.16	0.06
77	300168	万达信息	5,900	50,032.00	0.06
78	300349	金卡智能	4,000	49,680.00	0.06
79	603959	百利科技	5,500	48,895.00	0.06
80	603183	建研院	10,200	47,634.00	0.06
81	300388	节能国祯	7,400	47,582.00	0.06
82	301129	瑞纳智能	1,700	45,271.00	0.05
83	300918	南山智尚	4,200	43,386.00	0.05
84	300543	朗科智能	3,900	42,588.00	0.05
85	605080	浙江自然	2,000	42,340.00	0.05
86	300686	智动力	3,900	41,262.00	0.05
87	300636	同和药业	3,600	37,944.00	0.04
88	300848	美瑞新材	1,900	36,347.00	0.04
89	300425	中建环能	7,400	34,632.00	0.04
90	002180	纳思达	1,500	33,945.00	0.04
91	601668	中国建筑	7,000	33,670.00	0.04
92	688227	品高股份	1,754	33,448.78	0.04
93	688058	宝兰德	705	33,283.05	0.04
94	600082	海泰发展	9,600	33,120.00	0.04
95	002236	大华股份	1,700	31,365.00	0.04
96	002992	宝明科技	400	31,200.00	0.04
97	002775	文科股份	7,700	30,800.00	0.04
98	300138	晨光生物	2,200	29,546.00	0.03
99	002942	新农股份	1,500	29,475.00	0.03
100	301101	明月镜片	700	29,302.00	0.03
101	002529	海源复材	2,300	29,164.00	0.03
102	000661	长春高新	200	29,160.00	0.03
103	301002	崧盛股份	1,400	29,036.00	0.03
104	601899	紫金矿业	2,300	28,658.00	0.03
105	688323	瑞华泰	1,332	28,598.04	0.03
106	601168	西部矿业	2,000	28,540.00	0.03
107	300286	安科瑞	1,100	28,523.00	0.03
108	688788	科思科技	731	28,275.08	0.03
109	688678	福立旺	1,533	28,222.53	0.03
110	688015	交控科技	1,502	28,177.52	0.03
111	301011	华立科技	1,200	28,080.00	0.03
112	300805	电声股份	2,500	28,000.00	0.03
113	300791	仙乐健康	800	27,728.00	0.03
114	688616	西力科技	2,031	27,702.84	0.03
115	002449	国星光电	2,900	27,463.00	0.03

116	300920	润阳科技	1,300	27,365.00	0.03
117	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.03
118	603948	建业股份	1,200	27,288.00	0.03
119	600535	天士力	1,600	27,232.00	0.03
120	688585	上纬新材	3,214	27,222.58	0.03
121	301122	采纳股份	800	27,088.00	0.03
122	688030	山石网科	1,353	27,087.06	0.03
123	003025	思进智能	2,000	27,020.00	0.03
124	688109	品茗科技	955	26,902.35	0.03
125	300889	爱克股份	1,600	26,880.00	0.03
126	301017	漱玉平民	1,300	26,559.00	0.03
127	002600	领益智造	3,900	26,364.00	0.03
128	603889	新澳股份	3,700	26,344.00	0.03
129	002438	江苏神通	2,200	26,290.00	0.03
130	688669	聚石化学	1,400	26,236.00	0.03
131	300682	朗新集团	1,600	26,224.00	0.03
132	002422	科伦药业	900	26,145.00	0.03
133	300107	建新股份	4,900	26,117.00	0.03
134	603337	杰克股份	1,200	25,920.00	0.03
135	002543	万和电气	2,900	25,868.00	0.03
136	688231	隆达股份	1,174	25,839.74	0.03
137	688055	龙腾光电	5,286	25,795.68	0.03
138	002774	快意电梯	3,100	25,730.00	0.03
139	601231	环旭电子	1,700	25,687.00	0.03
140	600642	申能股份	4,000	25,680.00	0.03
141	605366	宏柏新材	3,100	25,637.00	0.03
142	688225	亚信安全	1,397	25,620.98	0.03
143	600746	江苏索普	3,500	25,620.00	0.03
144	688728	格科微	1,251	25,607.97	0.03
145	000997	新大陆	1,300	25,493.00	0.03
146	688267	中触媒	1,326	25,485.72	0.03
147	688329	艾隆科技	1,025	25,481.50	0.03
148	600863	内蒙华电	6,500	25,350.00	0.03
149	688335	复洁环保	1,975	25,339.25	0.03
150	605599	莱百股份	1,700	25,313.00	0.03
151	000039	中集集团	3,300	25,245.00	0.03
152	300257	开山股份	1,600	25,216.00	0.03
153	600066	宇通客车	1,900	25,175.00	0.03
154	603181	皇马科技	2,300	25,139.00	0.03
155	002327	富安娜	2,800	25,060.00	0.03
156	600153	建发股份	2,600	25,038.00	0.03
157	000598	兴蓉环境	4,400	25,036.00	0.03
158	600258	首旅酒店	1,600	24,992.00	0.03



159	300994	久祺股份	1,700	24,990.00	0.03
160	601018	宁波港	7,000	24,920.00	0.03
161	002798	帝欧家居	3,800	24,890.00	0.03
162	603115	海星股份	1,700	24,888.00	0.03
163	000823	超声电子	2,600	24,882.00	0.03
164	002035	华帝股份	4,000	24,840.00	0.03
164	603818	曲美家居	4,600	24,840.00	0.03
165	003036	泰坦股份	2,000	24,800.00	0.03
166	601298	青岛港	4,000	24,720.00	0.03
167	600774	汉商集团	2,500	24,650.00	0.03
168	601598	中国外运	4,700	24,628.00	0.03
169	688107	安路科技	669	24,605.82	0.03
170	603823	百合花	2,500	24,600.00	0.03
171	000930	中粮科技	3,700	24,568.00	0.03
172	000698	沈阳化工	5,800	24,476.00	0.03
173	003000	劲仔食品	2,000	24,440.00	0.03
174	605108	同庆楼	800	24,352.00	0.03
175	605268	王力安防	2,500	24,350.00	0.03
176	002398	垒知集团	5,100	24,327.00	0.03
177	603112	华翔股份	2,000	24,300.00	0.03
178	002128	电投能源	1,700	24,259.00	0.03
179	600894	广日股份	3,300	24,255.00	0.03
180	600790	轻纺城	6,100	24,217.00	0.03
181	002905	金逸影视	2,200	24,112.00	0.03
182	601866	中远海发	10,300	24,102.00	0.03
183	002688	金河生物	5,000	24,050.00	0.03
184	603385	惠达卫浴	3,000	24,030.00	0.03
185	605138	盛泰集团	3,100	24,025.00	0.03
186	002790	瑞尔特	2,300	24,012.00	0.03
187	300248	新开普	2,500	23,975.00	0.03
188	603520	司太立	1,700	23,936.00	0.03
189	601566	九牧王	2,400	23,928.00	0.03
190	601512	中新集团	3,100	23,901.00	0.03
191	002479	富春环保	5,000	23,850.00	0.03
192	601158	重庆水务	4,200	23,814.00	0.03
193	600901	江苏金租	4,900	23,716.00	0.03
194	300078	思创医惠	5,400	23,652.00	0.03
195	002019	亿帆医药	1,600	23,648.00	0.03
196	603096	新经典	1,200	23,616.00	0.03
197	002172	澳洋健康	6,200	23,498.00	0.03
198	002153	石基信息	2,400	23,376.00	0.03
199	603558	健盛集团	2,400	23,256.00	0.03
200	600033	福建高速	7,500	23,250.00	0.03

201	603579	荣泰健康	1,100	22,913.00	0.03
202	300043	星辉娱乐	6,100	22,631.00	0.03
203	600637	东方明珠	3,000	22,560.00	0.03
204	001330	博纳影业	3,100	22,320.00	0.03
205	605100	华丰股份	1,400	22,274.00	0.03
206	000156	华数传媒	3,000	22,110.00	0.03
207	600831	广电网络	4,000	20,960.00	0.02
208	000910	大亚圣象	2,600	20,800.00	0.02
209	600350	山东高速	2,900	20,126.00	0.02
210	600837	海通证券	2,000	18,740.00	0.02
211	300904	威力传动	304	18,705.12	0.02
212	301421	波长光电	277	16,445.49	0.02
213	688548	广钢气体	1,278	16,294.50	0.02
214	601225	陕西煤业	700	14,623.00	0.02
215	301510	固高科技	396	13,863.96	0.02
216	301509	金凯生科	217	13,503.91	0.02
217	605299	舒华体育	1,300	12,870.00	0.02
218	301362	民爆光电	310	11,941.20	0.01
219	600107	美尔雅	1,900	11,628.00	0.01
220	603296	华勤技术	147	11,429.25	0.01
221	301498	乖宝宠物	262	10,168.22	0.01
222	301372	科净源	231	10,069.29	0.01
223	688591	泰凌微	344	9,638.88	0.01
224	301511	德福科技	421	9,544.07	0.01
225	301518	长华化学	385	8,858.85	0.01
226	300274	阳光电源	100	8,759.00	0.01
227	000887	中鼎股份	700	8,659.00	0.01
228	301418	协昌科技	167	8,383.40	0.01
229	688573	信宇人	285	8,208.00	0.01
230	301371	敷尔佳	215	8,079.70	0.01
231	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.01
232	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.01
233	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.01
234	688450	光格科技	167	6,082.14	0.01
235	300877	金春股份	300	5,193.00	0.01
236	603119	浙江荣泰	211	5,036.57	0.01
237	301550	斯菱股份	107	4,661.99	0.01
238	688627	精智达	48	4,210.56	0.00
239	301489	思泉新材	64	4,103.04	0.00
240	301499	维科精密	135	3,905.55	0.00
241	603270	金帝股份	120	3,549.60	0.00
242	600160	巨化股份	200	3,298.00	0.00
243	301559	中集环科	166	3,027.84	0.00

244	688610	埃科光电	53	2,703.00	0.00
245	301505	苏州规划	71	2,542.51	0.00
246	688657	浩辰软件	31	2,425.13	0.00
247	301468	博盈特焊	77	2,326.94	0.00
248	603273	天元智能	110	2,086.70	0.00
249	603062	麦加芯彩	27	1,560.87	0.00
250	603681	永冠新材	100	1,510.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600612	老凤祥	6,976,849.00	2.80
2	600583	海油工程	6,540,052.00	2.63
3	600363	联创光电	6,479,562.53	2.60
4	603212	赛伍技术	6,302,121.00	2.53
5	601567	三星医疗	5,973,134.00	2.40
6	603466	风语筑	5,829,060.82	2.34
7	603997	继峰股份	5,791,287.00	2.33
8	600458	时代新材	5,772,911.00	2.32
9	601222	林洋能源	5,545,381.00	2.23
10	600977	中国电影	5,460,192.00	2.19
11	600761	安徽合力	5,329,890.38	2.14
12	300133	华策影视	5,288,254.00	2.12
13	603171	税友股份	5,282,380.36	2.12
14	688617	惠泰医疗	5,239,847.38	2.10
15	688277	天智航	5,229,096.43	2.10
16	600729	重庆百货	5,209,325.00	2.09
17	603595	东尼电子	5,150,133.00	2.07
18	688066	航天宏图	5,073,661.94	2.04
19	600850	电科数字	5,008,049.90	2.01
20	603609	禾丰股份	5,007,752.00	2.01

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601567	三星医疗	8,356,347.52	3.36
2	600612	老凤祥	7,757,538.70	3.11
3	600583	海油工程	7,059,714.00	2.83
4	603595	东尼电子	6,972,734.78	2.80
5	600363	联创光电	6,539,378.50	2.63

6	603212	赛伍技术	6,351,421.64	2.55
7	600729	重庆百货	6,317,106.99	2.54
8	688366	昊海生科	6,198,252.58	2.49
9	600761	安徽合力	6,110,034.08	2.45
10	600977	中国电影	6,109,635.52	2.45
11	603997	继峰股份	6,099,024.00	2.45
12	600458	时代新材	5,790,162.00	2.32
13	688066	航天宏图	5,641,504.39	2.27
14	600966	博汇纸业	5,608,173.90	2.25
15	600963	岳阳林纸	5,569,277.00	2.24
16	601222	林洋能源	5,560,379.00	2.23
17	600098	广州发展	5,471,796.65	2.20
18	603103	横店影视	5,471,486.67	2.20
19	600850	电科数字	5,464,828.40	2.19
20	603466	风语筑	5,436,694.00	2.18
21	688617	惠泰医疗	5,426,720.27	2.18
22	601921	浙版传媒	5,424,126.00	2.18
23	688277	天智航	5,290,936.46	2.12
24	600776	东方通信	5,275,549.00	2.12
25	688007	光峰科技	5,198,112.90	2.09
26	603609	禾丰股份	5,162,047.00	2.07
27	688556	高测股份	5,012,141.13	2.01
28	601886	江河集团	4,996,366.30	2.01

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,368,501,470.88
卖出股票收入（成交）总额	1,424,982,058.45

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	121,201.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,201.22

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名的股票不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
979	88,768.22	51,565,167.00	59.34	35,338,924.00	40.66

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信建投证券股份有限公司	10,275,571.00	11.82
2	招商证券股份有限公司	7,631,180.00	8.78
3	中信证券股份有限公司	5,355,301.00	6.16
4	国信证券股份有限公司	4,900,430.00	5.64
5	国泰君安证券股份有限公司	4,019,700.00	4.63
6	方正证券股份有限公司	3,759,277.00	4.33
7	平安资管—平安银行—平安资产创赢176号资产管理产品	3,742,200.00	4.31
8	张辉	3,379,000.00	3.89
9	东亚前海证券有限责任公司	2,061,800.00	2.37
10	华泰证券股份有限公司	2,047,245.00	2.36

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 11 月 24 日） 基金份额总额	1,250,904,091.00
本报告期期初基金份额总额	257,904,091.00
本报告期基金总申购份额	822,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	993,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,904,091.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2023 年 9 月 5 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，邓列军先生自 2023 年 9 月 4 日起担任本基金管理人首席信息官职务。公司总经理王立新先生自 2023 年 9 月 4 日起不再代任首席信息官职务。

##### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 55,000.00 元。该审计机构首次为本基金提供审计

服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	2	1,002,082,988.76	35.91	530,886.67	37.95	-
申万宏源	2	957,463,850.07	34.31	502,989.38	35.96	-
西南证券	4	831,377,450.16	29.79	364,985.21	26.09	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东北证券	5	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-



广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
西部证券	2	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
湘财证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信华南	0	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-

第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信华 南	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报, 证券时报	2023年3月8日
2	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023年4月17日
3	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023年4月20日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023年4月20日
5	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月2日
6	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月7日
7	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月9日
8	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月14日
9	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月15日
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为旗下银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办券	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023年6月20日

	商的公告》		
11	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023 年 6 月 21 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于增加浙商证券股份有限公司为旗下银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资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, 上海证券报	2023 年 6 月 21 日
13	《关于银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报	2023 年 6 月 27 日
14	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 19 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 7 月 19 日
16	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 8 月 29 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于增加东海证券股份有限公司为旗下部分基金流动性服务券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上海证券报, 证券时报	2023 年 9 月 7 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 9 月 21 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 10 月 11 日
21	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 10 月 24 日
23	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 10 月 24 日
24	《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2023 年 11 月 8 日

	新(2023年第1号)》	网站	
25	《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	2023年11月8日
26	《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	2023年11月17日
27	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2023年11月17日
28	《银华中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2023年第2号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023年11月17日
29	《银华基金管理股份有限公司关于增加华金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	2023年12月26日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20230811-20230813	0.00	63,060,500.00	62,480,800.00	579,700.00	0.67
	1	20230815-20230822	0.00	63,060,500.00	62,480,800.00	579,700.00	0.67
	2	20230427-20230503	12,303,238.00	234,150,313.00	236,177,980.00	10,275,571.00	11.82
	2	20230424-20230425	12,303,238.00	234,150,313.00	236,177,980.00	10,275,571.00	11.82
	2	20230530-20230530	12,303,238.00	234,150,313.00	236,177,980.00	10,275,571.00	11.82
	2	20230321-20230321	12,303,238.00	234,150,313.00	236,177,980.00	10,275,571.00	11.82
产品特有风险							
<p>投资人在投资本基金时, 将面临本基金的特定风险, 具体包括:</p> <p>1) 当基金份额集中度较高时, 少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高, 其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权;</p> <p>2) 在极端情况下, 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元, 进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金, 其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会;</p>							

- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 更容易触发巨额赎回条款, 基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券, 可能造成证券价格波动, 导致本基金的收益水平发生波动。同时, 巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提, 会导致基金份额净值出现大幅波动;
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时, 本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下, 该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%, 该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 11 月 17 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》, 本基金可根据投资策略需要或市场环境变化, 选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票, 基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《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合同》

13.1.4 《银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

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



### 13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 3 月 29 日