

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 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 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	48

8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62
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	62
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	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	MSCI 中国
场内简称	MSCI 中国（扩位证券简称：MSCI 中国 ETF）
基金主代码	512380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 19 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	108,805,582.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 4 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金财产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股人民币指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露 负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95588
传真		(010) 58163027	(010) 66105798
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-9,691,046.18	-4,530,709.81	-14,507,006.53
本期利润	20,181,378.93	-17,217,548.96	-40,561,003.81
加权平均基金份额本期利润	0.1701	-0.1296	-0.2760
本期加权平均净值利润率	14.16%	-10.15%	-20.38%
本期基金份额净值增长率	14.76%	-10.32%	-18.35%
3.1.2 期	2024 年末	2023 年末	2022 年末

末数据和指标			
期末可供分配利润	35,777,881.32	20,973,359.72	40,410,787.19
期末可供分配基金份额利润	0.3288	0.1579	0.2911
期末基金资产净值	144,583,463.32	153,778,941.72	179,216,369.19
期末基金份额净值	1.3288	1.1579	1.2911
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	32.88%	15.79%	29.11%

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

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

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

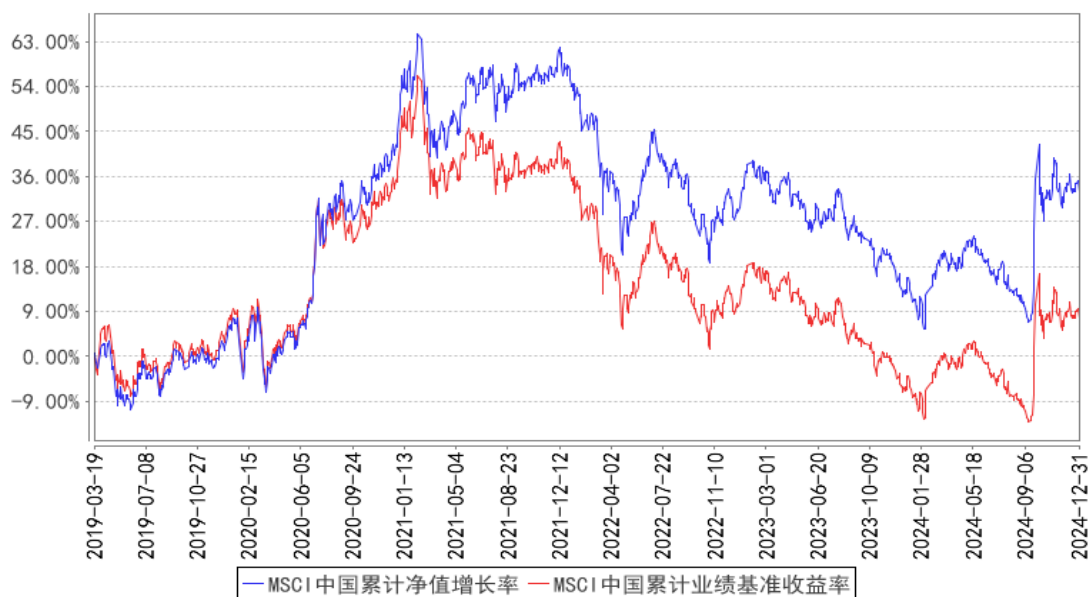
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.81%	1.68%	-2.47%	1.71%	0.66%	-0.03%
过去六个月	14.11%	1.63%	12.14%	1.66%	1.97%	-0.03%
过去一年	14.76%	1.35%	12.14%	1.37%	2.62%	-0.02%
过去三年	-15.97%	1.15%	-22.70%	1.18%	6.73%	-0.03%
过去五年	26.99%	1.21%	1.16%	1.23%	25.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	32.88%	1.19%	7.61%	1.22%	25.27%	-0.03%

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

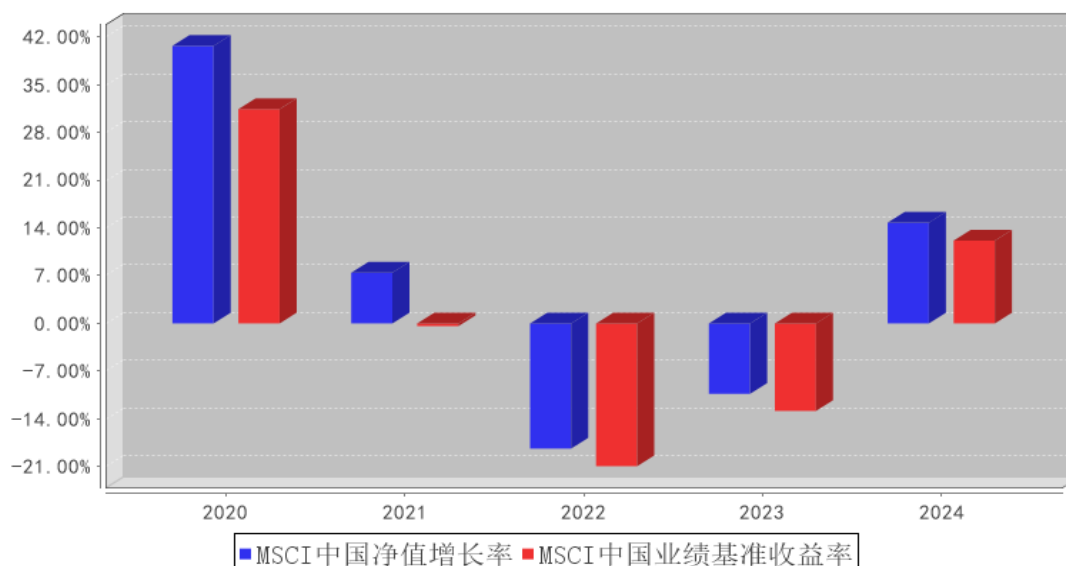
MSCI中国累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金财产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

MSCI中国基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2024 年末，银华基金管理公募基金 217 只，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基金、债券型基金及货币市场基金等各类产品，拥有完善的产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续四年实现经营层面碳中和。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2019 年 3 月 19 日	—	16.5 年	硕士学位。毕业于中国人民大学。2008 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理等职，自 2011 年 9 月 26 日起至 2014 年 1 月 6 日期间担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2012 年 8 月 23 日至 2020 年 11 月 26 日兼任上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2012 年 8 月 29 日至 2021 年 1 月 7 日兼任银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2013 年 5 月 22 日至 2016 年 4 月 25 日兼任银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金经理，自 2014 年 1 月 7 日至 2018 年 3 月 7 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金（由

					银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 转型)基金经理,自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 3 月 7 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理,自 2017 年 9 月 15 日至 2018 年 12 月 26 日兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2017 年 11 月 9 日至 2018 年 12 月 26 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2018 年 1 月 18 日至 2021 年 6 月 18 日兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理,自 2018 年 10 月 22 日起兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2018 年 11 月 15 日至 2023 年 3 月 21 日兼任银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,自 2019 年 3 月 19 日起兼任银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2019 年 6 月 5 日至 2022 年 8 月 5 日兼任银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理,自 2022 年 2 月 18 日至 2024 年 8 月 28 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。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	2021 年 4 月 19 日	-	11 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金,历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员,现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍: 中国。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原

则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有7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

2024年,国内外的宏观经济运行都呈现出一些新的特点。国内方面,经济主基调是在新旧转换的过程中寻求质与量的平衡点。分经济部门来看,居民消费领域仍然延续了此前的复苏趋势,而商务活动的复苏进程仍然较弱。这样的消费结构使消费领域呈现年节化、家庭化、中低价位段的特征。此外,宏观政策在诸多方面提升了支持力度,包括地产、化债、消费补贴、资本市场支持等。国外方面,美联储三次下调联邦基金利率,正式进入降息周期;而另一方面,伴随美国政

府的换届，其货币、财政、关税政策仍存在预期不明朗之处。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在 2024 年明显反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3288 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.76%，业绩比较基准收益率为 12.14%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，宏观政策对经济的支撑作用有望逐步显现。从更远的视角来看，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，都将是一个缓慢但持续的过程；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基于风险的反洗钱理念，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，尽早发现和处理业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历。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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00372 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

	在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。	
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： (1) 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。 (2) 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。 (3) 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。 (4) 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，就可能导致对银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金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银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 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。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	韩玫	强占新
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	3,154,950.03	2,714,134.09
结算备付金		733,796.96	1,391,703.71
存出保证金		140,053.65	134,617.26
交易性金融资产	7.4.7.2	140,982,865.83	149,965,315.62
其中：股票投资		140,982,865.83	149,965,315.62
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		-	-
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		145,011,666.47	154,205,770.68
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
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		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		61,708.38	64,099.80
应付托管费		12,341.68	12,819.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,768.42	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	350,384.67	349,909.19
负债合计		428,203.15	426,828.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	108,805,582.00	132,805,582.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	35,777,881.32	20,973,359.72
净资产合计		144,583,463.32	153,778,941.72
负债和净资产总计		145,011,666.47	154,205,770.68

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3288 元，基金份额总额 108,805,582.00 份。

7.2 利润表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		21,482,085.25	-15,713,806.40
1. 利息收入		23,249.46	41,472.51
其中：存款利息收入	7.4.7.13	23,249.46	41,472.51
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）		-8,440,677.16	-3,056,367.88
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-12,566,001.35	-6,843,680.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-

衍生工具收益	7.4.7.18	112,045.27	-16,696.33
股利收益	7.4.7.19	4,013,278.92	3,804,009.02
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	29,872,425.11	-12,686,839.15
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	27,087.84	-12,071.88
减：二、营业总支出		1,300,706.32	1,503,742.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	713,588.43	849,914.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,717.63	169,982.84
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		403.76	174.96
8. 其他费用	7.4.7.23	443,996.50	483,670.66
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		20,181,378.93	-17,217,548.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		20,181,378.93	-17,217,548.96
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		20,181,378.93	-17,217,548.96

7.3 净资产变动表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	132,805,582.00	-	20,973,359.72	153,778,941.72
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	132,805,582.00	-	20,973,359.72	153,778,941.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-	14,804,521.60	-9,195,478.40
(一)、综合收益总额	-	-	20,181,378.93	20,181,378.93
(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)	-24,000,000.00	-	-5,376,857.33	-29,376,857.33
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	-	3,024,161.53	21,024,161.53
2. 基金赎回款	-42,000,000.00	-	-8,401,018.86	-50,401,018.86
(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	108,805,582.00	-	35,777,881.32	144,583,463.32
项目	上年度可比期间 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	138,805,582.00	-	40,410,787.19	179,216,369.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	138,805,582.00	-	40,410,787.19	179,216,369.19

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,000,000.00	-	-19,437,427.47	-25,437,427.47
(一)、综合收益总额	-	-	-17,217,548.96	-17,217,548.96
(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)	-6,000,000.00	-	-2,219,878.51	-8,219,878.51
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	-	7,659,539.73	37,659,539.73
2. 基金赎回款	-36,000,000.00	-	-9,879,418.24	-45,879,418.24
(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	132,805,582.00	-	20,973,359.72	153,778,941.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

基金管理人负责人

凌宇翔

主管会计工作负责人

伍军辉

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1209 号文批准公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 2,058,805,582.00 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证。基金合同于 2019 年 3 月 19 日(基金合同生效日)正式

生效。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金财产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股人民币指数，英文全称为：MSCI China A RMB Index，指数代码为：718711。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

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

2. 金融负债分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认

后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或

使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(2) 投资收益

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

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

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

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

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

(3) 公允价值变动收益

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

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配，基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；
- (2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
- (3) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (4) 本基金收益分配采取现金分红方式；
- (5) 每一基金份额享有同等分配权；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

- (1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。
- (2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。
- (3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566 号）所规定的固定收益品种，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种使用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税;
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税;
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,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) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再

缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,154,950.03	2,714,134.09
等于：本金	3,154,613.54	2,713,844.76
加：应计利息	336.49	289.33
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	3,154,950.03	2,714,134.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		136,917,835.46	-	140,982,865.83	4,065,030.37
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		136,917,835.46	-	140,982,865.83	4,065,030.37
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		175,788,230.36	-	149,965,315.62	-25,822,914.74
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		175,788,230.36	-	149,965,315.62	-25,822,914.74

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,141,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,141,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,141,960.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,080,800.00	-	-	-
其中：股指	1,080,800.00	-	-	-

期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,080,800.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2506	IC2506	1.00	1,116,840.00	-25,120.00
合计				-25,120.00
减：可抵销期货暂收款				-25,120.00
净额				0.00

注：当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2024 年 12 月 31 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。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	1,679.39	16,203.91
其中：交易所市场	1,679.39	16,203.91
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	170,000.00
应付指数使用费	198,705.28	163,705.28
合计	350,384.67	349,909.19

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,805,582.00	132,805,582.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,000,000.00	-42,000,000.00
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	108,805,582.00	108,805,582.00

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	93,609,689.01	-72,636,329.29	20,973,359.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	93,609,689.01	-72,636,329.29	20,973,359.72
本期利润	-9,691,046.18	29,872,425.11	20,181,378.93
本期基金份额交易产生的变动数	-15,847,596.41	10,470,739.08	-5,376,857.33
其中：基金申购款	11,485,611.97	-8,461,450.44	3,024,161.53
金赎回款	-27,333,208.38	18,932,189.52	-8,401,018.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,071,046.42	-32,293,165.10	35,777,881.32

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,537.45	15,550.52
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	12,654.41	25,769.91
其他	57.60	152.08
合计	23,249.46	41,472.51

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,126,055.05	-5,258,077.90
股票投资收益——赎回差价收入	-1,439,946.30	-1,585,602.67
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	-12,566,001.35	-6,843,680.57

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	33,358,466.34	52,163,886.23
减：卖出股票成本总额	44,450,430.65	57,289,912.92
减：交易费用	34,090.74	132,051.21
买卖股票差价收入	-11,126,055.05	-5,258,077.90

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

赎回基金份额对价总额	50,401,018.86	45,879,418.24
减：现金支付赎回款总额	19,212,212.86	19,567,263.24
减：赎回股票成本总额	32,628,752.30	27,897,757.67
减：交易费用	—	—
赎回差价收入	-1,439,946.30	-1,585,602.67

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	112,045.27	-16,696.33

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,013,278.92	3,804,009.02
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	4,013,278.92	3,804,009.02

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	29,887,945.11	-12,761,319.15
股票投资	29,887,945.11	-12,761,319.15
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	-15,520.00	74,480.00
权证投资	-	-
期货投资	-15,520.00	74,480.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	29,872,425.11	-12,686,839.15

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	27,087.84	-12,071.88
合计	27,087.84	-12,071.88

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	498.00	557.00
指数使用费	143,498.50	163,113.66
其他	150,000.00	150,000.00
合计	443,996.50	483,670.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东、基金代销机构

东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

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。

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	713,588.43	849,914.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,615.13	19,120.29
应支付基金管理人的净管理费	666,973.30	830,793.81

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

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	142,717.63	169,982.84

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
西南证券	14,584.00	0.01	14,584.00	0.01

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,154,950.03	10,537.45	2,714,134.09	15,550.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金本报告期末投资于基金托管人（中国工商银行股份有限公司）发行的股票：工商银行（代码 601398）255,644.00 股，期末公允价值为人民币 1,769,056.48 元，占本基金期末基金资产净值比例为 1.22%。

本基金本报告期末投资于基金管理人股东（西南证券股份有限公司）发行的股票：西南证券（代码 600369）22,900.00 股，期末公允价值为人民币 106,943.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.07%。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2024 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
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	12.30	12.30	1,085	13,345.50	13,345.50	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	121	1,488.30	1,488.30	-
603091	众鑫股份	2024 年 9 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.50	44.43	69	1,828.50	3,065.67	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	110	2,235.20	3,094.30	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	77	1,436.05	1,740.97	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	80	1,391.20	1,436.00	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	55	2,200.00	2,274.25	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	573	6,446.25	16,869.12	-

688615	合合信息	2024年9月19日	6个月	新股流通受限	55.18	165.78	79	4,359.22	13,096.62	-
688710	益诺思	2024年8月27日	6个月	新股流通受限	19.06	33.58	210	4,002.60	7,051.80	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	6个月	新股流通受限	18.50	56.85	208	3,848.00	11,824.80	-
688750	金天钛业	2024年11月12日	6个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,011	7,238.76	15,609.84	-

注：1：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

2：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10%的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024年12月23日	重大事项停牌	7.22	2025年1月7日	6.93	22,928	152,899.02	165,540.16	-

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同责任，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约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,154,950.03	-	-	-	3,154,950.03
结算备付金	733,796.96	-	-	-	733,796.96
存出保证金	140,053.65	-	-	-	140,053.65
交易性金融资产	-	-	-	140,982,865.83	140,982,865.83
资产总计	4,028,800.64	-	-	140,982,865.83	145,011,666.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	61,708.38	61,708.38
应付托管费	-	-	-	12,341.68	12,341.68
应交税费	-	-	-	3,768.42	3,768.42

其他负债	-	-	-	350,384.67	350,384.67
负债总计	-	-	-	428,203.15	428,203.15
利率敏感度缺口	4,028,800.64	-	-	-140,554,662.68	144,583,463.32
上年度末 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	2,714,134.09	-	-	-	2,714,134.09
结算备付金	1,391,703.71	-	-	-	1,391,703.71
存出保证金	134,617.26	-	-	-	134,617.26
交易性金融资产	-	-	-	-149,965,315.62	149,965,315.62
资产总计	4,240,455.06	-	-	-149,965,315.62	154,205,770.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	64,099.80	64,099.80
应付托管费	-	-	-	12,819.97	12,819.97
其他负债	-	-	-	349,909.19	349,909.19
负债总计	-	-	-	426,828.96	426,828.96
利率敏感度缺口	4,240,455.06	-	-	-149,538,486.66	153,778,941.72

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

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	140,982,865.83	97.51	149,965,315.62	97.52
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	140,982,865.83	97.51	149,965,315.62	97.52

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%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	7,079,876.17	7,444,992.98
	业绩比较基准下降 5%	-7,079,876.17	-7,444,992.98

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	140,720,919.92	149,814,316.08
第二层次	180,373.96	—
第三层次	81,571.95	150,999.54
合计	140,982,865.83	149,965,315.62

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	—	150,999.54	150,999.54
当期购买	—	—	—
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	37,709.10	37,709.10
转出第三层次	—	118,920.47	118,920.47
当期利得或损失总额	—	11,783.78	11,783.78
其中：计入损益的利得或损失	—	11,783.78	11,783.78
计入其他综合收益的利得或损失	—	—	—

期末余额	-	81,571.95	81,571.95
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	-	45,357.25	45,357.25
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	-	175,849.97	175,849.97
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	198,244.30	198,244.30
转出第三层次	-	290,483.81	290,483.81
当期利得或损失总额	-	67,389.08	67,389.08
其中：计入损益的利得或损失	-	67,389.08	67,389.08
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	150,999.54	150,999.54
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	14,704.21	14,704.21

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
股票投资	81,571.95	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2665-4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	150,999.54	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本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

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7.4.16 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金管理人批准报出。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	140,982,865.83	97.22
	其中：股票	140,982,865.83	97.22
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	3,888,746.99	2.68
8	其他各项资产	140,053.65	0.10
9	合计	145,011,666.47	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	1,195,376.05	0.83
B	采矿业	7,219,697.29	4.99
C	制造业	74,782,012.05	51.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,660,176.41	4.61

E	建筑业	2,613,060.35	1.81
F	批发和零售业	860,027.88	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	5,431,659.70	3.76
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,712,314.84	3.95
J	金融业	32,549,057.90	22.51
K	房地产业	1,361,356.84	0.94
L	租赁和商务服务业	1,161,372.64	0.80
M	科学研究和技术服务业	684,750.52	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	127,011.36	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	427,034.25	0.30
R	文化、体育和娱乐业	101,552.00	0.07
S	综合	—	—
	合计	140,886,460.08	97.44

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	59,388.21	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,965.74	0.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	7,051.80	0.00
N	水利、环境和公共	—	—

	设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,405.75	0.07

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	600519	贵州茅台	4,420	6,736,080.00	4.66
2	300750	宁德时代	15,130	4,024,580.00	2.78
3	600036	招商银行	71,278	2,801,225.40	1.94
4	600900	长江电力	84,596	2,499,811.80	1.73
5	000858	五粮液	17,019	2,383,340.76	1.65
6	601318	中国平安	37,174	1,957,211.10	1.35
7	601398	工商银行	255,644	1,769,056.48	1.22
8	601288	农业银行	330,048	1,762,456.32	1.22
9	002594	比亚迪	6,196	1,751,361.36	1.21
10	300059	东方财富	54,572	1,409,049.04	0.97
11	601166	兴业银行	71,818	1,376,032.88	0.95
12	600030	中信证券	42,306	1,234,066.02	0.85
13	601816	京沪高铁	199,500	1,228,920.00	0.85
14	688041	海光信息	8,000	1,198,320.00	0.83
15	300760	迈瑞医疗	4,247	1,082,985.00	0.75
16	601899	紫金矿业	71,116	1,075,273.92	0.74
17	601328	交通银行	135,704	1,054,420.08	0.73
18	688256	寒武纪	1,600	1,052,800.00	0.73
19	600000	浦发银行	101,449	1,043,910.21	0.72
20	002475	立讯精密	25,043	1,020,752.68	0.71
21	600276	恒瑞医药	22,033	1,011,314.70	0.70
22	601088	中国神华	22,792	990,996.16	0.69
23	601138	工业富联	45,705	982,657.50	0.68
24	000333	美的集团	12,000	902,640.00	0.62
25	601668	中国建筑	143,768	862,608.00	0.60
26	000725	京东方 A	184,625	810,503.75	0.56

27	601601	中国太保	23,691	807,389.28	0.56
28	600028	中国石化	119,941	801,205.88	0.55
29	601988	中国银行	144,520	796,305.20	0.55
30	600809	山西汾酒	4,268	786,208.28	0.54
31	000001	平安银行	67,084	784,882.80	0.54
32	601225	陕西煤业	33,457	778,209.82	0.54
33	600309	万华化学	10,847	773,933.45	0.54
34	601766	中国中车	92,190	772,552.20	0.53
35	002371	北方华创	1,927	753,457.00	0.52
36	603288	海天味业	16,036	736,052.40	0.51
37	601857	中国石油	82,114	734,099.16	0.51
38	002714	牧原股份	18,888	726,054.72	0.50
39	600406	国电南瑞	27,830	701,872.60	0.49
40	601818	光大银行	179,511	694,707.57	0.48
41	601127	赛力斯	5,200	693,628.00	0.48
42	601919	中远海控	44,131	684,030.50	0.47
43	601985	中国核电	65,338	681,475.34	0.47
44	002352	顺丰控股	16,589	668,536.70	0.46
45	600887	伊利股份	21,926	661,726.68	0.46
46	000063	中兴通讯	16,346	660,378.40	0.46
47	600104	上汽集团	31,651	657,074.76	0.45
48	601658	邮储银行	113,083	642,311.44	0.44
49	000568	泸州老窖	5,090	637,268.00	0.44
50	600050	中国联通	119,791	636,090.21	0.44
51	600919	江苏银行	63,354	622,136.28	0.43
52	600690	海尔智家	21,637	616,005.39	0.43
53	600905	三峡能源	129,822	567,322.14	0.39
54	300033	同花顺	1,971	566,662.50	0.39
55	000166	申万宏源	105,888	566,500.80	0.39
56	002142	宁波银行	22,846	555,386.26	0.38
57	600150	中国船舶	15,424	554,647.04	0.38
58	600019	宝钢股份	76,075	532,525.00	0.37
59	300274	阳光电源	7,190	530,837.70	0.37
60	601390	中国中铁	80,032	511,404.48	0.35
61	600016	民生银行	122,556	506,156.28	0.35
62	688111	金山办公	1,721	492,877.19	0.34
63	600999	招商证券	25,633	491,128.28	0.34
64	000100	TCL 科技	96,586	485,827.58	0.34
65	601211	国泰君安	25,903	483,090.95	0.33
66	000625	长安汽车	36,117	482,523.12	0.33
67	600031	三一重工	29,257	482,155.36	0.33
68	300308	中际旭创	3,898	481,441.98	0.33
69	603259	药明康德	8,707	479,233.28	0.33

70	600989	宝丰能源	28,451	479,114.84	0.33
71	601600	中国铝业	63,484	466,607.40	0.32
72	601888	中国中免	6,711	449,704.11	0.31
73	601169	北京银行	73,074	449,405.10	0.31
74	601229	上海银行	49,071	448,999.65	0.31
75	688012	中微公司	2,366	447,552.56	0.31
76	601688	华泰证券	25,306	445,132.54	0.31
77	600436	片仔癀	2,061	442,084.50	0.31
78	000651	格力电器	9,718	441,683.10	0.31
79	603501	韦尔股份	4,221	440,714.61	0.30
80	600660	福耀玻璃	6,934	432,681.60	0.30
81	601727	上海电气	53,113	430,746.43	0.30
82	002304	洋河股份	5,146	429,845.38	0.30
83	601006	大秦铁路	63,108	427,872.24	0.30
84	600886	国投电力	25,700	427,134.00	0.30
85	300015	爱尔眼科	32,229	427,034.25	0.30
86	000938	紫光股份	15,014	417,839.62	0.29
87	601012	隆基绿能	26,136	410,596.56	0.28
88	603993	洛阳钼业	61,010	405,716.50	0.28
89	601628	中国人寿	9,545	400,126.40	0.28
90	688271	联影医疗	3,100	391,840.00	0.27
91	000792	盐湖股份	23,700	390,102.00	0.27
92	601009	南京银行	36,583	389,608.95	0.27
93	002230	科大讯飞	8,044	388,686.08	0.27
94	605499	东鹏饮料	1,560	387,691.20	0.27
95	601066	中信建投	14,998	386,198.50	0.27
96	601881	中国银河	25,053	381,557.19	0.26
97	600893	航发动力	9,156	379,516.20	0.26
98	300498	温氏股份	22,958	379,036.58	0.26
99	300433	蓝思科技	17,234	377,424.60	0.26
100	001979	招商蛇口	36,643	375,224.32	0.26
101	000425	徐工机械	47,248	374,676.64	0.26
102	600346	恒力石化	24,370	374,079.50	0.26
103	600837	海通证券	33,339	370,729.68	0.26
104	000538	云南白药	6,122	367,013.90	0.25
105	600015	华夏银行	45,812	366,954.12	0.25
106	600048	保利发展	41,391	366,724.26	0.25
107	000895	双汇发展	14,080	365,516.80	0.25
108	601336	新华保险	7,232	359,430.40	0.25
109	002625	光启技术	7,502	358,595.60	0.25
110	688036	传音控股	3,727	354,065.00	0.24
111	002027	分众传媒	49,893	350,747.79	0.24
112	002463	沪电股份	8,720	345,748.00	0.24

113	600438	通威股份	15,553	343,876.83	0.24
114	688223	晶科能源	47,976	341,109.36	0.24
115	000921	海信家电	11,800	341,020.00	0.24
116	002736	国信证券	30,005	336,056.00	0.23
117	002938	鹏鼎控股	9,132	333,135.36	0.23
118	000776	广发证券	20,505	332,386.05	0.23
119	300014	亿纬锂能	7,074	330,638.76	0.23
120	600585	海螺水泥	13,840	329,115.20	0.23
121	601669	中国电建	59,472	324,717.12	0.22
122	000338	潍柴动力	23,417	320,812.90	0.22
123	601111	中国国航	40,190	317,902.90	0.22
124	002493	荣盛石化	35,056	317,256.80	0.22
125	601319	中国人保	40,910	311,734.20	0.22
126	002241	歌尔股份	11,867	306,287.27	0.21
127	001965	招商公路	21,500	299,925.00	0.21
128	600926	杭州银行	20,454	298,832.94	0.21
129	600010	包钢股份	156,939	291,906.54	0.20
130	600674	川投能源	16,893	291,404.25	0.20
131	601939	建设银行	33,110	291,036.90	0.20
132	003816	中国广核	70,400	290,752.00	0.20
133	601689	拓普集团	5,832	285,768.00	0.20
134	600418	江淮汽车	7,600	285,000.00	0.20
135	601825	沪农商行	33,300	283,383.00	0.20
136	601868	中国能建	123,417	282,624.93	0.20
137	600795	国电电力	61,659	282,398.22	0.20
138	600547	山东黄金	12,440	281,517.20	0.19
139	601995	中金公司	8,353	281,412.57	0.19
140	002311	海大集团	5,726	280,860.30	0.19
141	601877	正泰电器	11,851	277,431.91	0.19
142	300502	新易盛	2,400	277,392.00	0.19
143	000963	华东医药	8,017	277,388.20	0.19
144	300124	汇川技术	4,727	276,907.66	0.19
145	601916	浙商银行	93,499	272,082.09	0.19
146	600958	东方证券	25,742	271,835.52	0.19
147	000596	古井贡酒	1,531	265,322.30	0.18
148	000977	浪潮信息	5,111	265,158.68	0.18
149	601607	上海医药	12,591	264,411.00	0.18
150	600111	北方稀土	12,423	263,616.06	0.18
151	688008	澜起科技	3,854	261,686.60	0.18
152	000999	华润三九	5,880	260,719.20	0.18
153	300442	润泽科技	5,000	259,800.00	0.18
154	603392	万泰生物	3,650	257,179.00	0.18
155	300408	三环集团	6,652	256,168.52	0.18

156	601360	三六零	24,512	253,699.20	0.18
157	600415	小商品城	18,918	253,690.38	0.18
158	600029	南方航空	38,877	252,311.73	0.17
159	600221	海航控股	148,100	251,770.00	0.17
160	600584	长电科技	6,152	251,370.72	0.17
161	601100	恒立液压	4,729	249,549.33	0.17
162	000617	中油资本	36,100	248,729.00	0.17
163	601788	光大证券	13,529	245,010.19	0.17
164	600188	兖矿能源	17,208	243,837.36	0.17
165	000002	万 科 A	33,586	243,834.36	0.17
166	603986	兆易创新	2,244	239,659.20	0.17
167	601901	方正证券	28,500	237,405.00	0.16
168	000423	东阿阿胶	3,784	237,332.48	0.16
169	600115	中国东航	59,173	236,692.00	0.16
170	002001	新 和 成	10,745	236,067.65	0.16
171	002916	深南电路	1,872	234,000.00	0.16
172	601838	成都银行	13,131	224,671.41	0.16
173	601633	长城汽车	8,529	224,568.57	0.16
174	000807	云铝股份	16,594	224,516.82	0.16
175	600160	巨化股份	9,306	224,460.72	0.16
176	601618	中国中冶	67,943	224,211.90	0.16
177	600089	特变电工	17,483	222,733.42	0.15
178	002648	卫星化学	11,719	220,200.01	0.15
179	002600	领益智造	27,485	219,880.00	0.15
180	300122	智飞生物	8,334	219,184.20	0.15
181	600023	浙能电力	38,700	219,042.00	0.15
182	600845	宝信软件	7,450	217,987.00	0.15
183	000786	北新建材	7,151	216,746.81	0.15
184	000066	中国长城	14,826	216,014.82	0.15
185	600011	华能国际	31,718	214,730.86	0.15
186	300896	爱美客	1,170	213,525.00	0.15
187	688396	华润微	4,503	212,496.57	0.15
188	000157	中联重科	29,295	211,802.85	0.15
189	600703	三安光电	17,300	210,541.00	0.15
190	301269	华大九天	1,700	205,870.00	0.14
191	603296	华勤技术	2,900	205,755.00	0.14
192	002920	德赛西威	1,849	203,593.39	0.14
193	600332	白云山	7,163	203,572.46	0.14
194	600066	宇通客车	7,700	203,126.00	0.14
195	600183	生益科技	8,439	202,957.95	0.14
196	000783	长江证券	29,588	201,790.16	0.14
197	600489	中金黄金	16,700	200,901.00	0.14
198	603369	今世缘	4,413	199,599.99	0.14

199	000630	铜陵有色	61,624	199,045.52	0.14
200	000301	东方盛虹	24,084	197,729.64	0.14
201	002128	电投能源	10,075	197,268.50	0.14
202	601865	福莱特	9,984	196,584.96	0.14
203	600600	青岛啤酒	2,428	196,473.76	0.14
204	601021	春秋航空	3,400	196,078.00	0.14
205	600085	同仁堂	4,800	194,832.00	0.13
206	002028	思源电气	2,678	194,690.60	0.13
207	601238	广汽集团	20,796	194,234.64	0.13
208	301236	软通动力	3,300	193,743.00	0.13
209	600741	华域汽车	10,960	193,005.60	0.13
210	002460	赣锋锂业	5,496	192,414.96	0.13
211	002202	金风科技	18,622	192,365.26	0.13
212	600803	新奥股份	8,844	191,737.92	0.13
213	300866	安克创新	1,950	190,398.00	0.13
214	002049	紫光国微	2,947	189,698.39	0.13
215	000728	国元证券	22,645	189,312.20	0.13
216	300832	新产业	2,663	188,673.55	0.13
217	601377	兴业证券	29,781	186,429.06	0.13
218	601179	中国西电	24,500	185,955.00	0.13
219	601077	渝农商行	30,605	185,160.25	0.13
220	600570	恒生电子	6,580	184,174.20	0.13
221	605117	德业股份	2,164	183,507.20	0.13
222	300999	金龙鱼	5,623	183,366.03	0.13
223	002236	大华股份	11,407	182,512.00	0.13
224	600196	复星医药	7,317	181,827.45	0.13
225	601872	招商轮船	28,200	180,762.00	0.13
226	600025	华能水电	18,700	177,837.00	0.12
227	000988	华工科技	4,100	177,530.00	0.12
228	688126	沪硅产业	9,357	176,098.74	0.12
229	300782	卓胜微	1,961	175,901.70	0.12
230	601117	中国化学	21,144	175,283.76	0.12
231	600096	云天化	7,800	173,940.00	0.12
232	300394	天孚通信	1,900	173,584.00	0.12
233	300413	芒果超媒	6,450	173,440.50	0.12
234	002384	东山精密	5,841	170,557.20	0.12
235	300628	亿联网络	4,411	170,264.60	0.12
236	603799	华友钴业	5,802	169,766.52	0.12
237	600522	中天科技	11,852	169,720.64	0.12
238	002466	天齐锂业	5,100	168,300.00	0.12
239	688072	拓荆科技	1,095	168,268.65	0.12
240	600233	圆通速递	11,852	168,179.88	0.12
241	600061	国投资本	22,200	166,944.00	0.12

242	600745	闻泰科技	4,278	165,900.84	0.11
243	002422	科伦药业	5,537	165,722.41	0.11
244	002252	上海莱士	22,928	165,540.16	0.11
245	688009	中国通号	26,442	165,526.92	0.11
246	300418	昆仑万维	4,300	165,464.00	0.11
247	603893	瑞芯微	1,500	165,090.00	0.11
248	600027	华电国际	29,400	164,934.00	0.11
249	601878	浙商证券	13,403	164,052.72	0.11
250	000738	航发控制	7,370	163,908.80	0.11
251	601058	赛轮轮胎	11,431	163,806.23	0.11
252	002281	光迅科技	3,100	161,727.00	0.11
253	000983	山西焦煤	19,567	161,232.08	0.11
254	600642	申能股份	16,900	160,381.00	0.11
255	600426	华鲁恒升	7,361	159,071.21	0.11
256	688047	龙芯中科	1,200	158,736.00	0.11
257	600918	中泰证券	24,111	158,409.27	0.11
258	600219	南山铝业	40,414	158,018.74	0.11
259	600176	中国巨石	13,855	157,808.45	0.11
260	002064	华峰化学	19,286	157,759.48	0.11
261	002459	晶澳科技	11,435	157,231.25	0.11
262	688187	时代电气	3,273	156,842.16	0.11
263	603195	公牛集团	2,220	155,932.80	0.11
264	600177	雅戈尔	17,514	155,874.60	0.11
265	601567	三星医疗	5,000	153,800.00	0.11
266	600733	北汽蓝谷	19,200	153,600.00	0.11
267	601216	君正集团	29,125	153,197.50	0.11
268	600875	东方电气	9,608	152,671.12	0.11
269	002156	通富微电	5,161	152,507.55	0.11
270	600256	广汇能源	22,656	152,474.88	0.11
271	688188	柏楚电子	784	152,292.00	0.11
272	002444	巨星科技	4,700	152,045.00	0.11
273	603260	合盛硅业	2,723	151,289.88	0.10
274	000661	长春高新	1,514	150,552.16	0.10
275	002050	三花智控	6,400	150,464.00	0.10
276	000408	藏格矿业	5,400	149,742.00	0.10
277	600515	海南机场	39,500	149,310.00	0.10
278	002939	长城证券	18,163	148,936.60	0.10
279	601699	潞安环能	10,362	148,798.32	0.10
280	600009	上海机场	4,349	148,518.35	0.10
281	600460	士兰微	5,697	148,235.94	0.10
282	601799	星宇股份	1,110	148,162.80	0.10
283	688169	石头科技	672	147,362.88	0.10
284	688303	大全能源	6,100	147,254.00	0.10

285	600362	江西铜业	7,134	147,245.76	0.10
286	000975	山金国际	9,546	146,722.02	0.10
287	600487	亨通光电	8,518	146,679.96	0.10
288	002601	龙佰集团	8,286	146,413.62	0.10
289	600039	四川路桥	20,047	145,942.16	0.10
290	688777	中控技术	2,937	145,880.79	0.10
291	688120	华海清科	894	145,713.06	0.10
292	601991	大唐发电	51,000	145,350.00	0.10
293	300316	晶盛机电	4,549	145,113.10	0.10
294	688599	天合光能	7,516	145,058.80	0.10
295	002078	太阳纸业	9,650	143,495.50	0.10
296	300207	欣旺达	6,381	142,360.11	0.10
297	000729	燕京啤酒	11,800	142,072.00	0.10
298	600895	张江高科	5,300	142,040.00	0.10
299	600161	天坛生物	6,880	141,040.00	0.10
300	000876	新希望	15,668	140,698.64	0.10
301	300661	圣邦股份	1,719	140,579.82	0.10
302	002085	万丰奥威	7,400	140,230.00	0.10
303	002180	纳思达	4,976	140,173.92	0.10
304	600026	中远海能	11,989	139,072.40	0.10
305	601136	首创证券	6,300	138,600.00	0.10
306	002456	欧菲光	11,500	137,770.00	0.10
307	603160	汇顶科技	1,700	136,918.00	0.09
308	002595	豪迈科技	2,700	135,513.00	0.09
309	600536	中国软件	2,880	134,467.20	0.09
310	601555	东吴证券	17,206	134,206.80	0.09
311	601162	天风证券	29,900	133,952.00	0.09
312	002966	苏州银行	16,500	133,815.00	0.09
313	000708	中信特钢	11,700	133,497.00	0.09
314	601168	西部矿业	8,300	133,381.00	0.09
315	603806	福斯特	8,973	132,800.40	0.09
316	000933	神火股份	7,827	132,276.30	0.09
317	002353	杰瑞股份	3,557	131,573.43	0.09
318	600157	永泰能源	76,800	131,328.00	0.09
319	600985	淮北矿业	9,300	130,851.00	0.09
320	601108	财通证券	15,980	130,556.60	0.09
321	002074	国轩高科	6,142	130,333.24	0.09
322	603156	养元饮品	5,700	130,188.00	0.09
323	002709	天赐材料	6,590	129,954.80	0.09
324	300759	康龙化成	5,049	129,759.30	0.09
325	300765	新诺威	4,880	129,759.20	0.09
326	002185	华天科技	11,132	129,242.52	0.09
327	600998	九州通	24,926	127,621.12	0.09

328	603833	欧派家居	1,850	127,539.00	0.09
329	600079	人福医药	5,454	127,514.52	0.09
330	600588	用友网络	11,855	127,204.15	0.09
331	603568	伟明环保	5,872	127,011.36	0.09
332	002532	天山铝业	16,096	126,675.52	0.09
333	300476	胜宏科技	3,000	126,270.00	0.09
334	002673	西部证券	15,412	125,607.80	0.09
335	601880	辽港股份	72,600	125,598.00	0.09
336	000027	深圳能源	19,381	125,588.88	0.09
337	002223	鱼跃医疗	3,421	124,832.29	0.09
338	600398	海澜之家	16,600	124,500.00	0.09
339	002129	TCL 中环	14,016	124,321.92	0.09
340	601577	长沙银行	13,869	123,295.41	0.09
341	601198	东兴证券	11,190	123,201.90	0.09
342	603606	东方电缆	2,333	122,599.15	0.08
343	603198	迎驾贡酒	2,240	120,825.60	0.08
344	002555	三七互娱	7,681	120,130.84	0.08
345	300223	北京君正	1,740	118,668.00	0.08
346	300919	中伟股份	3,274	118,256.88	0.08
347	603659	璞泰来	7,429	118,195.39	0.08
348	002294	信立泰	3,817	118,059.81	0.08
349	603338	浙江鼎力	1,821	117,490.92	0.08
350	600352	浙江龙盛	11,300	116,277.00	0.08
351	002340	格林美	17,796	116,207.88	0.08
352	601456	国联民生	8,337	112,716.24	0.08
353	601958	金钼股份	11,200	112,672.00	0.08
354	600109	国金证券	12,800	111,744.00	0.08
355	000960	锡业股份	7,960	111,678.80	0.08
356	601966	玲珑轮胎	6,159	111,108.36	0.08
357	002414	高德红外	14,844	110,290.92	0.08
358	600132	重庆啤酒	1,750	110,285.00	0.08
359	601990	南京证券	12,700	109,982.00	0.08
360	600038	中直股份	2,827	109,009.12	0.08
361	300751	迈为股份	1,033	108,619.95	0.08
362	688122	西部超导	2,506	107,306.92	0.07
363	600153	建发股份	10,193	107,230.36	0.07
364	600369	西南证券	22,900	106,943.00	0.07
365	002007	华兰生物	6,346	106,930.10	0.07
366	002812	恩捷股份	3,336	106,718.64	0.07
367	600298	安琪酵母	2,960	106,708.00	0.07
368	601696	中银证券	9,552	106,600.32	0.07
369	688099	晶晨股份	1,541	105,835.88	0.07
370	601231	环旭电子	6,400	105,600.00	0.07

371	603885	吉祥航空	7,700	105,490.00	0.07
372	002032	苏泊尔	1,978	105,249.38	0.07
373	000800	一汽解放	12,784	104,828.80	0.07
374	600968	海油发展	24,400	104,188.00	0.07
375	000831	中国稀土	3,626	101,709.30	0.07
376	603939	益丰药房	4,212	101,635.56	0.07
377	601928	凤凰传媒	8,800	101,552.00	0.07
378	688728	格科微	7,500	100,800.00	0.07
379	688082	盛美上海	1,000	100,000.00	0.07
380	600282	南钢股份	21,300	99,897.00	0.07
381	000932	华菱钢铁	23,868	99,768.24	0.07
382	002409	雅克科技	1,716	99,442.20	0.07
383	002152	广电运通	8,520	99,343.20	0.07
384	600873	梅花生物	9,900	99,297.00	0.07
385	601233	桐昆股份	8,334	98,341.20	0.07
386	600497	驰宏锌锗	17,600	98,032.00	0.07
387	300699	光威复材	2,812	97,435.80	0.07
388	300037	新宙邦	2,574	96,370.56	0.07
389	600549	厦门钨业	4,956	95,502.12	0.07
390	002821	凯莱英	1,250	95,112.50	0.07
391	002465	海格通信	8,549	93,868.02	0.06
392	603899	晨光股份	3,088	93,412.00	0.06
393	600566	济川药业	3,200	93,056.00	0.06
394	002603	以岭药业	5,768	92,345.68	0.06
395	000629	钒钛股份	32,041	92,278.08	0.06
396	688538	和辉光电	39,768	92,261.76	0.06
397	688363	华熙生物	1,800	91,872.00	0.06
398	600521	华海药业	5,096	91,065.52	0.06
399	603596	伯特利	2,040	90,963.60	0.06
400	603486	科沃斯	1,926	90,522.00	0.06
401	600598	北大荒	6,121	90,284.75	0.06
402	300763	锦浪科技	1,473	89,956.11	0.06
403	600988	赤峰黄金	5,700	88,977.00	0.06
404	600511	国药股份	2,600	88,972.00	0.06
405	600021	上海电力	9,700	88,949.00	0.06
406	600582	天地科技	14,300	88,374.00	0.06
407	600348	华阳股份	12,461	88,348.49	0.06
408	603658	安图生物	2,000	87,280.00	0.06
409	603345	安井食品	1,061	86,450.28	0.06
410	600970	中材国际	9,100	86,268.00	0.06
411	002262	恩华药业	3,500	85,225.00	0.06
412	601666	平煤股份	8,500	85,170.00	0.06
413	600848	上海临港	8,339	84,223.90	0.06

414	600546	山煤国际	6,900	81,627.00	0.06
415	688065	凯赛生物	2,100	81,480.00	0.06
416	603979	金诚信	2,100	76,230.00	0.05
417	300347	泰格医药	1,387	75,757.94	0.05
418	002271	东方雨虹	4,200	54,516.00	0.04

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	688449	联芸科技	573	16,869.12	0.01
2	688750	金天钛业	1,011	15,609.84	0.01
3	603072	天和磁材	1,206	14,833.80	0.01
4	688615	合合信息	79	13,096.62	0.01
5	688721	龙图光罩	208	11,824.80	0.01
6	688710	益诺思	210	7,051.80	0.00
7	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
8	603194	中力股份	110	3,094.30	0.00
9	603091	众鑫股份	69	3,065.67	0.00
10	603391	力聚热能	55	2,274.25	0.00
11	603285	键邦股份	77	1,740.97	0.00
12	603310	巍华新材	80	1,436.00	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	000333	美的集团	1,067,084.00	0.69
2	000858	五粮液	906,779.00	0.59
3	300750	宁德时代	680,941.00	0.44
4	000921	海信家电	461,763.00	0.30
5	002594	比亚迪	428,551.00	0.28
6	000725	京东方 A	338,124.00	0.22
7	001965	招商公路	303,082.00	0.20
8	601398	工商银行	291,123.00	0.19
9	600519	贵州茅台	281,420.00	0.18
10	002475	立讯精密	243,689.00	0.16
11	601288	农业银行	229,391.00	0.15
12	688223	晶科能源	223,588.09	0.15
13	600025	华能水电	217,389.00	0.14
14	000708	中信特钢	209,551.00	0.14
15	000166	申万宏源	209,316.00	0.14
16	300760	迈瑞医疗	208,077.00	0.14
17	601816	京沪高铁	202,664.00	0.13

18	000100	TCL 科技	197,473.00	0.13
19	002714	牧原股份	194,910.00	0.13
20	600900	长江电力	193,317.00	0.13

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,267,746.00	0.82
2	000858	五 粮 液	768,299.00	0.50
3	002594	比亚迪	703,093.00	0.46
4	300760	迈瑞医疗	413,533.00	0.27
5	300059	东方财富	381,139.00	0.25
6	002475	立讯精密	376,532.00	0.24
7	002714	牧原股份	346,580.00	0.23
8	000001	平安银行	309,706.00	0.20
9	000333	美的集团	297,163.00	0.19
10	002352	顺丰控股	290,113.00	0.19
11	688449	联芸科技	278,917.10	0.18
12	000568	泸州老窖	252,606.00	0.16
13	688750	金天钛业	241,987.79	0.16
14	002142	宁波银行	225,744.00	0.15
15	002602	ST 华通	222,945.80	0.14
16	000725	京东方 A	210,757.00	0.14
17	300274	阳光电源	208,602.00	0.14
18	300498	温氏股份	196,666.00	0.13
19	300308	中际旭创	188,477.00	0.12
20	603395	红四方	185,732.66	0.12

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	24,987,505.05
卖出股票收入（成交）总额	33,358,466.34

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	140,053.65
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	140,053.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688449	联芸科技	16,869.12	0.01	新股流通受限
2	688750	金天钛业	15,609.84	0.01	新股流通受限
3	603072	天和磁材	14,833.80	0.01	新股流通受限
4	688615	合合信息	13,096.62	0.01	新股流通受限
5	688721	龙图光罩	11,824.80	0.01	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,328	81,931.91	72,445,285.00	66.58	36,360,297.00	33.42

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	国开金融有限责任公司	46,440,000.00	42.68
2	永安国富资产管理有限公司—永安国富—稳健6号私募基金	12,370,600.00	11.37
3	中信建投证券股份有限公司	4,204,745.00	3.86
4	广发证券股份有限公司	3,621,435.00	3.33
5	方正证券股份有限公司	2,509,632.00	2.31

	司		
6	陈燕	2,000,000.00	1.84
7	中信证券股份有限公司	1,393,622.00	1.28
8	王明华	1,300,000.00	1.19
9	于忠宝	1,000,000.00	0.92
9	赵汝佳	1,000,000.00	0.92

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，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 3 月 19 日） 基金份额总额	2,058,805,582.00
本报告期期初基金份额总额	132,805,582.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	42,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	108,805,582.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动
本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 30,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 6 年的审计服务。

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	1	15,343,979.72	26.48	4,207.07	30.72	—
国海证券	2	14,551,103.60	25.11	2,123.44	15.51	—
国泰君安	3	10,928,175.79	18.86	3,771.04	27.54	—
中信证券	2	9,552,654.66	16.48	1,394.28	10.18	—
长江证券	2	7,579,970.00	13.08	2,198.37	16.05	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东方财富	5	—	—	—	—	撤销 2 个交易单元
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—

光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	撤销 2 个 交易 单元
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	撤销 1 个 交易 单元
西南证券	3	-	-	-	-	新增 2 个 交易 单元
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	撤销 2 个 交易 单元
中金财富	1	-	-	-	-	-

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

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作

券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

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

4、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024 年 6 月 30 日前完成股票交易佣金费率的调整。

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(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证	-	-	-	-	-	-

券						
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 1 月 19 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于增加华宝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	2024 年 2 月 7 日
4	《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	2024 年 3 月 5 日
5	《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	2024 年 3 月 19 日
6	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
7	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 3 月 29 日
8	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 19 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 4 月 19 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加中泰证券股份有限公司为旗下银华 MSCI 中国 A 股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, 证券时报	2024 年 5 月 23 日
11	《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	2024 年 5 月 29 日
12	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指	本基金管理人网站, 中	2024 年 6 月 28 日

	数证券投资基金基金产品资料概要更新》	国证监会基金电子披露网站	
13	《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	2024 年 6 月 28 日
14	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 7 月 18 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 7 月 18 日
16	《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	2024 年 7 月 24 日
17	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 8 月 31 日
18	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 8 月 31 日
19	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 10 月 24 日
20	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 10 月 24 日
21	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2024 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 20 日
22	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 20 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	20240101-20241231	46,440,000.00	0.00	0.00	46,440,000.00	42.68
产品特有风险							
投资人在投资本基金时, 将面临本基金的特定风险, 具体包括:							

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.4 《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相

关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2025 年 3 月 28 日