

银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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 银华）
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	72,805,582.00 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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,188,485.25
本期利润	10,544,262.93
加权平均基金份额本期利润	0.1342
本期加权平均净值利润率	8.15%
本期基金份额净值增长率	8.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	53,425,807.45
期末可供分配基金份额利润	0.7338
期末基金资产净值	126,231,389.45
期末基金份额净值	1.7338
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	73.38%

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、

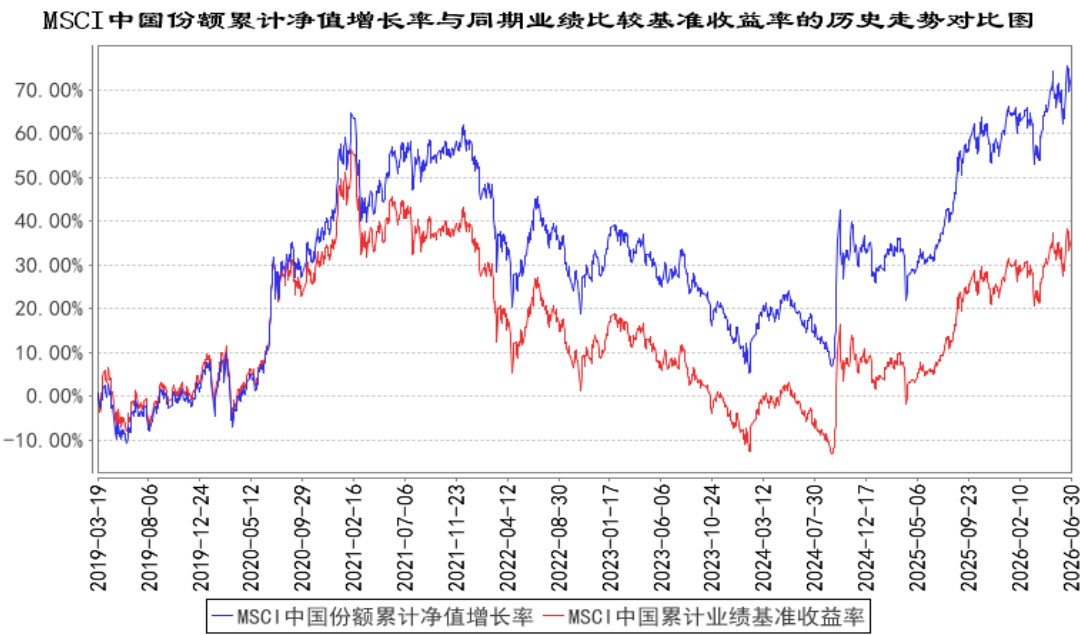
申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.31%	1.28%	11.74%	1.30%	0.57%	-0.02%
过去六个月	8.46%	1.16%	7.81%	1.18%	0.65%	-0.02%
过去一年	29.18%	1.03%	26.95%	1.04%	2.23%	-0.01%
过去三年	36.26%	1.11%	27.14%	1.13%	9.12%	-0.02%
过去五年	9.92%	1.09%	-5.77%	1.12%	15.69%	-0.03%
过去七年	79.99%	1.15%	38.20%	1.17%	41.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	73.38%	1.16%	36.17%	1.18%	37.21%	-0.02%

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



§ 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 2026 年 6 月底，银华基金管理公募基金 255 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续六年实现运营层面碳中和。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2019 年 3 月 19 日	—	17.5 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。
张卓希女士	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 22 日	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永（中国）企业咨询有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
郭九良先生	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理股份有限公司，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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内宏观调控政策持续发力，内需修复进程延续推进。消费品以旧换新补贴等政策持续实施，春节、清明、五一等多轮假期配套各地线下促消费专项活动，居民出行、终端商品消费景气度呈现企稳回升。依托海外出口需求韧性与国内稳内需政策双向支撑，制造业 PMI 连续多月运行于扩张区间，生产端与需求端同步实现边际改善。海外方面，中东地缘冲突反复扰动大宗商品，原油高位震荡，黄金冲高回落；美国通胀数据波动扩大，美联储上半年维持高基准利率不变，持续释放货币政策中长期偏紧信号，美元指数整体保持强势，新兴市场持续面临资本外流、本币汇率承压的双重压力。在上述因素的作用下，A 股市场在上半年呈现典型的结构性行情。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7338 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.46%，业绩比较基准收益率为 7.81%。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 2026 年下半年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替

正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，内需的恢复进程、海外地缘冲突等指标将是边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,023,764.19	3,612,628.62
结算备付金		1,460,901.92	1,143,430.49
存出保证金		217,841.20	181,790.63
交易性金融资产	6.4.7.2	122,344,702.61	135,652,723.36
其中：股票投资		122,344,702.61	135,652,723.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		129,047,209.92	140,590,573.10
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,612,813.13	739.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,768.79	55,556.65
应付托管费		10,353.75	11,111.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	10,669.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	140,884.80	153,274.41
负债合计		2,815,820.47	231,351.22
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	72,805,582.00	87,805,582.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	53,425,807.45	52,553,639.88
净资产合计		126,231,389.45	140,359,221.88
负债和净资产总计		129,047,209.92	140,590,573.10

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7338 元，基金份额总额 72,805,582.00 份。

6.2 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,064,508.45	1,623,072.27
1. 利息收入		12,197.16	9,859.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,197.16	9,859.25
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）		11,625,166.65	1,628,741.80

其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,240,057.53	5,934.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	288,462.62	2,235.49
股利收益	6.4.7.19	1,096,646.50	1,620,571.87
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-644,222.32	3,211.81
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	71,366.96	-18,740.59
减：二、营业总支出		520,245.52	573,629.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	320,886.38	329,092.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,177.25	65,818.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,038.76	8.24
8. 其他费用	6.4.7.23	134,143.13	178,710.06
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		10,544,262.93	1,049,442.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		10,544,262.93	1,049,442.94
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		10,544,262.93	1,049,442.94

6.3 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	87,805,582.00	—	52,553,639.88	140,359,221.88
加：会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	87,805,582.00	—	52,553,639.88	140,359,221.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,000,000.00	—	872,167.57	-14,127,832.43
（一）、综合收益总额	—	—	10,544,262.93	10,544,262.93
（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）	-15,000,000.00	—	-9,672,095.36	-24,672,095.36
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	—	19,879,750.66	49,879,750.66
2. 基金赎回款	-45,000,000.00	—	-29,551,846.02	-74,551,846.02
（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	72,805,582.00	—	53,425,807.45	126,231,389.45
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	108,805,582.00	-	35,777,881.32	144,583,463.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	108,805,582.00	-	35,777,881.32	144,583,463.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-	-2,648,332.38	-14,648,332.38
（一）、综合收益总额	-	-	1,049,442.94	1,049,442.94
（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）	-12,000,000.00	-	-3,697,775.32	-15,697,775.32
其中：1. 基金申购款	9,000,000.00	-	2,601,845.10	11,601,845.10
2. 基金赎回款	-21,000,000.00	-	-6,299,620.42	-27,299,620.42
（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	96,805,582.00	-	33,129,548.94	129,935,130.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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。

6.4.3 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财税[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《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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

(3) 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，暂不征收企业所得税；

(4) 对基金取得的股票股息红利所得，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；

(5)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，对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；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	5,023,764.19
等于：本金	5,023,511.18
加：应计利息	253.01
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	5,023,764.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		104,406,270.88	-	122,344,702.61	17,938,431.73
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		104,406,270.88	-	122,344,702.61	17,938,431.73

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	1,602,920.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,602,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,602,920.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	149,360.00
合计				149,360.00
减：可抵销期货暂收款				149,360.00
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 2026 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零

元。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,993.67
其中：交易所市场	6,993.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	133,891.13
合计	140,884.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,805,582.00	87,805,582.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-45,000,000.00	-45,000,000.00
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	72,805,582.00	72,805,582.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,340,322.59	-10,786,682.71	52,553,639.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	63,340,322.59	-10,786,682.71	52,553,639.88
本期利润	11,188,485.25	-644,222.32	10,544,262.93
本期基金份额交易产生的变动数	-11,616,053.64	1,943,958.28	-9,672,095.36
其中：基金申购款	24,186,057.72	-4,306,307.06	19,879,750.66
基金赎回款	-35,802,111.36	6,250,265.34	-29,551,846.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,912,754.20	-9,486,946.75	53,425,807.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,378.41
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	7,804.94
其他	13.81
合计	12,197.16

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,485,178.95
股票投资收益——赎回差价收入	3,754,878.58
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	10,240,057.53

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,008,294.74
减：卖出股票成本总额	33,488,098.70
减：交易费用	35,017.09
买卖股票差价收入	6,485,178.95

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	74,551,846.02
减：现金支付赎回款总额	33,490,750.02
减：赎回股票成本总额	37,306,217.42
减：交易费用	—
赎回差价收入	3,754,878.58

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	288,462.62

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,096,646.50
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	1,096,646.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-694,222.32
股票投资	-694,222.32
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	50,000.00
权证投资	—
期货投资	50,000.00
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	-644,222.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	71,366.96
合计	71,366.96

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	252.00
其他	59,507.37
合计	134,143.13

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	320,886.38	329,092.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	102,651.90	74,506.08
应支付基金管理人的净管理费	218,234.48	254,586.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,177.25	65,818.50

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年6月30日		上年度末 2025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	0.02	14,584.00	0.02

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,023,764.19	4,378.41	4,111,939.99	5,474.34

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金托管人（中国工商银行股份有限公司）发行的股票：工商银行（代码 601398）147,044.00 股，期末公允价值为人民币 1,039,601.08 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.82%。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	596	95,542.88	495,872.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司

的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,023,764.19	-	-	-	5,023,764.19
结算备付金	1,460,901.92	-	-	-	1,460,901.92
存出保证金	217,841.20	-	-	-	217,841.20
交易性金融资产	-	-	-	122,344,702.61	122,344,702.61
资产总计	6,702,507.31	-	-	122,344,702.61	129,047,209.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,768.79	51,768.79
应付托管费	-	-	-	10,353.75	10,353.75
应付清算款	-	-	-	2,612,813.13	2,612,813.13
其他负债	-	-	-	140,884.80	140,884.80
负债总计	-	-	-	2,815,820.47	2,815,820.47
利率敏感度缺口	6,702,507.31	-	-	119,528,882.14	126,231,389.45
上年度末 2025 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	3,612,628.62	-	-	-	3,612,628.62
结算备付金	1,143,430.49	-	-	-	1,143,430.49
存出保证金	181,790.63	-	-	-	181,790.63
交易性金融资产	-	-	-	135,652,723.36	135,652,723.36
资产总计	4,937,849.74	-	-	135,652,723.36	140,590,573.10
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	55,556.65	55,556.65
应付托管费	-	-	-	11,111.34	11,111.34
应付清算款	-	-	-	739.03	739.03
应交税费	-	-	-	10,669.79	10,669.79
其他负债	-	-	-	153,274.41	153,274.41

负债总计	-	-	-	231,351.22	231,351.22
利率敏感度缺口	4,937,849.74	-	-	135,421,372.14	140,359,221.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	122,344,702.61	96.92	135,652,723.36	96.65
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	122,344,702.61	96.92	135,652,723.36	96.65
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,216,017.29	6,877,104.78
	业绩比较基准下降 5%	-6,216,017.29	-6,877,104.78

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	121,848,830.61	134,975,713.71
第二层次	495,872.00	632,172.11
第三层次	-	44,837.54
合计	122,344,702.61	135,652,723.36

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	122,344,702.61	94.81
	其中：股票	122,344,702.61	94.81
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	6,484,666.11	5.03
8	其他各项资产	217,841.20	0.17
9	合计	129,047,209.92	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	639,126.68	0.51
B	采矿业	5,581,683.47	4.42

C	制造业	77,520,316.79	61.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,695,795.04	2.93
E	建筑业	1,351,241.21	1.07
F	批发和零售业	659,120.44	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	2,949,055.13	2.34
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,588,942.71	5.22
J	金融业	20,674,900.79	16.38
K	房地产业	534,829.38	0.42
L	租赁和商务服务业	725,332.81	0.57
M	科学研究和技术服务业	860,585.14	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	72,993.48	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	180,307.54	0.14
R	文化、体育和娱乐业	75,412.00	0.06
S	综合	235,060.00	0.19
	合计	122,344,702.61	96.92

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	10,330	4,059,793.30	3.22
2	600519	贵州茅台	2,920	3,461,630.80	2.74
3	300308	中际旭创	2,598	3,299,460.00	2.61
4	688256	寒武纪	1,441	2,299,187.55	1.82
5	688041	海光信息	5,414	2,004,804.20	1.59
6	300502	新易盛	3,276	1,988,532.00	1.58

7	601138	工业富联	24,805	1,789,680.75	1.42
8	600036	招商银行	48,278	1,713,869.00	1.36
9	600900	长江电力	57,196	1,513,978.12	1.20
10	002371	北方华创	1,666	1,473,676.96	1.17
11	603986	兆易创新	1,544	1,258,360.00	1.00
12	601899	紫金矿业	48,216	1,212,150.24	0.96
13	601288	农业银行	198,948	1,207,614.36	0.96
14	002475	立讯精密	17,043	1,199,827.20	0.95
15	601318	中国平安	24,774	1,182,710.76	0.94
16	002384	东山精密	4,241	1,112,626.35	0.88
17	688012	中微公司	2,291	1,073,333.50	0.85
18	601398	工商银行	147,044	1,039,601.08	0.82
19	002594	比亚迪	12,688	1,011,233.60	0.80
20	600183	生益科技	5,639	977,802.60	0.77
21	688008	澜起科技	2,766	857,183.40	0.68
22	601166	兴业银行	49,418	818,362.08	0.65
23	600030	中信证券	28,406	816,104.38	0.65
24	601328	交通银行	124,704	801,846.72	0.64
25	600276	恒瑞医药	14,833	771,909.32	0.61
26	300394	天孚通信	2,548	771,228.64	0.61
27	300274	阳光电源	4,790	761,705.80	0.60
28	300059	东方财富	36,872	751,451.36	0.60
29	300408	三环集团	4,452	743,038.80	0.59
30	000725	京东方 A	84,925	737,149.00	0.58
31	002916	深南电路	1,603	734,013.70	0.58
32	603259	药明康德	5,807	723,029.57	0.57
33	603993	洛阳钼业	40,810	716,215.50	0.57
34	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.56
35	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.55
36	600176	中国巨石	9,355	681,792.40	0.54
37	002463	沪电股份	4,420	675,376.00	0.54
38	600000	浦发银行	77,749	669,418.89	0.53
39	000858	五 粮 液	9,019	667,406.00	0.53
40	600487	亨通光电	5,818	636,140.12	0.50
41	000333	美的集团	8,200	619,346.00	0.49
42	300433	蓝思科技	11,534	618,914.44	0.49
43	601211	国泰海通	33,033	601,200.60	0.48
44	600150	中国船舶	17,624	595,514.96	0.47
45	688498	源杰科技	290	546,940.00	0.43
46	601988	中国银行	92,920	531,502.40	0.42
47	601816	京沪高铁	114,400	518,232.00	0.41
48	300604	长川科技	1,500	512,130.00	0.41
49	000657	中钨高新	5,300	507,316.00	0.40

50	601088	中国神华	12,892	503,303.68	0.40
51	601857	中国石油	57,814	501,825.52	0.40
52	688072	拓荆科技	596	495,872.00	0.39
53	600309	万华化学	7,247	495,767.27	0.39
54	688525	佰维存储	1,000	494,730.00	0.39
55	002281	光迅科技	1,900	488,186.00	0.39
56	600522	中天科技	7,952	482,527.36	0.38
57	601939	建设银行	49,510	476,781.30	0.38
58	001309	德明利	500	471,450.00	0.37
59	002938	鹏鼎控股	4,432	467,044.16	0.37
60	600919	江苏银行	42,854	461,966.12	0.37
61	601225	陕西煤业	22,557	459,034.95	0.36
62	000001	平安银行	45,384	456,109.20	0.36
63	601601	中国太保	15,991	456,063.32	0.36
64	002142	宁波银行	15,346	455,622.74	0.36
65	002714	牧原股份	12,788	447,452.12	0.35
66	688521	芯原股份	1,200	445,368.00	0.35
67	601985	中国核电	48,138	434,686.14	0.34
68	000338	潍柴动力	15,817	431,013.25	0.34
69	600584	长电科技	4,152	429,939.60	0.34
70	600406	国电南瑞	18,730	427,980.50	0.34
71	000988	华工科技	2,300	424,603.00	0.34
72	601668	中国建筑	96,568	419,105.12	0.33
73	300033	同花顺	1,719	414,279.00	0.33
74	600111	北方稀土	8,323	399,920.15	0.32
75	300857	协创数据	1,160	394,284.00	0.31
76	601919	中远海控	29,331	388,929.06	0.31
77	300760	迈瑞医疗	2,847	386,708.01	0.31
78	601869	长飞光纤	700	382,130.00	0.30
79	000792	盐湖股份	12,400	374,356.00	0.30
80	600999	招商证券	17,333	365,726.30	0.29
81	688120	华海清科	1,124	362,130.32	0.29
82	002353	杰瑞股份	2,357	359,442.50	0.28
83	603288	海天味业	10,736	356,005.76	0.28
84	600887	伊利股份	14,726	352,834.96	0.28
85	601688	华泰证券	17,106	352,725.72	0.28
86	002080	中材科技	3,900	351,000.00	0.28
87	600989	宝丰能源	17,151	348,679.83	0.28
88	002352	顺丰控股	11,089	346,642.14	0.27
89	601658	邮储银行	70,183	346,002.19	0.27
90	600031	三一重工	19,857	343,128.96	0.27
91	000063	中兴通讯	9,346	338,231.74	0.27
92	601100	恒立液压	3,129	336,555.24	0.27

93	601872	招商轮船	18,900	332,073.00	0.26
94	300475	香农芯创	1,100	330,000.00	0.26
95	600160	巨化股份	6,106	323,679.06	0.26
96	605117	德业股份	3,026	321,300.68	0.25
97	000776	广发证券	13,705	320,697.00	0.25
98	300014	亿纬锂能	4,874	316,956.22	0.25
99	300442	润泽科技	3,800	315,666.00	0.25
100	600809	山西汾酒	2,868	313,673.16	0.25
101	601818	光大银行	108,411	313,307.79	0.25
102	600549	厦门钨业	3,656	311,491.20	0.25
103	688396	华润微	3,173	309,526.15	0.25
104	688126	沪硅产业	7,617	303,842.13	0.24
105	600028	中国石化	68,041	303,462.86	0.24
106	688361	中科飞测	700	301,000.00	0.24
107	600690	海尔智家	14,537	296,700.17	0.24
108	002600	领益智造	17,085	296,253.90	0.23
109	601766	中国中车	56,790	295,308.00	0.23
110	601066	中信建投	10,098	293,548.86	0.23
111	688347	华虹宏力	869	292,244.70	0.23
112	600050	中国联通	72,991	291,964.00	0.23
113	601336	新华保险	4,832	288,277.12	0.23
114	601229	上海银行	33,171	287,924.28	0.23
115	601009	南京银行	28,883	285,652.87	0.23
116	300223	君正股份	1,140	283,746.00	0.22
117	000100	TCL 科技	48,486	282,188.52	0.22
118	688249	晶合集成	4,695	277,145.85	0.22
119	600019	宝钢股份	50,875	276,251.25	0.22
120	000568	泸州老窖	3,490	270,544.80	0.21
121	002156	通富微电	3,561	270,173.07	0.21
122	603501	豪威集团	2,821	267,571.85	0.21
123	600016	民生银行	82,856	266,796.32	0.21
124	600089	特变电工	11,783	265,117.50	0.21
125	300136	信维通信	2,200	262,350.00	0.21
126	688082	盛美上海	600	259,200.00	0.21
127	601600	中国铝业	30,884	253,866.48	0.20
128	000408	藏格矿业	3,600	249,552.00	0.20
129	600905	三峡能源	66,822	247,909.62	0.20
130	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.20
131	600703	三安光电	11,600	246,152.00	0.20
132	600926	杭州银行	16,954	244,985.30	0.19
133	000651	格力电器	6,518	244,425.00	0.19
134	601995	中金公司	6,753	244,120.95	0.19
135	002602	世纪华通	17,200	242,520.00	0.19

136	601888	中国中免	4,511	242,285.81	0.19
137	601169	北京银行	49,374	241,932.60	0.19
138	002460	赣锋锂业	3,696	241,718.40	0.19
139	002709	天赐材料	4,690	241,206.70	0.19
140	000977	浪潮信息	3,411	238,770.00	0.19
141	002837	英维克	2,990	237,884.40	0.19
142	688111	金山办公	1,115	237,550.75	0.19
143	600893	航发动力	6,156	236,021.04	0.19
144	600010	包钢股份	105,739	235,797.97	0.19
145	600673	东阳光	7,000	235,060.00	0.19
146	600346	恒力石化	13,270	235,011.70	0.19
147	002851	麦格米特	1,400	234,052.00	0.19
148	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.19
149	600660	福耀玻璃	4,634	233,738.96	0.19
150	601127	赛力斯	3,800	232,750.00	0.18
151	000166	申万宏源	52,688	231,827.20	0.18
152	601012	隆基绿能	17,636	231,384.32	0.18
153	002493	荣盛石化	21,356	229,577.00	0.18
154	600886	国投电力	17,200	228,932.00	0.18
155	600188	兖矿能源	12,808	227,598.16	0.18
156	601689	拓普集团	4,032	227,485.44	0.18
157	300620	光库科技	600	226,920.00	0.18
158	600105	永鼎股份	3,300	222,684.00	0.18
159	002230	科大讯飞	5,444	222,332.96	0.18
160	000425	徐工机械	27,348	221,245.32	0.18
161	600498	烽火通信	3,000	220,800.00	0.17
162	601868	中国能建	81,617	217,917.39	0.17
163	688777	中控技术	1,850	217,375.00	0.17
164	601006	大秦铁路	47,108	217,167.88	0.17
165	300661	圣邦股份	1,505	215,937.40	0.17
166	002466	天齐锂业	3,500	214,620.00	0.17
167	688183	生益电子	1,617	214,090.80	0.17
168	300124	汇川技术	3,227	214,046.91	0.17
169	603799	华友钴业	4,402	212,440.52	0.17
170	600362	江西铜业	4,834	209,312.20	0.17
171	600460	士兰微	3,797	207,544.02	0.16
172	688469	芯联集成	19,481	206,693.41	0.16
173	601727	上海电气	29,513	206,591.00	0.16
174	688629	华丰科技	1,100	206,261.00	0.16
175	600875	东方电气	7,108	204,497.16	0.16
176	688313	仕佳光子	1,100	203,115.00	0.16
177	002001	新 和 成	7,145	203,060.90	0.16
178	600489	中金黄金	11,200	202,160.00	0.16

179	603296	华勤技术	2,720	202,014.40	0.16
180	688048	长光华芯	400	200,800.00	0.16
181	601390	中国中铁	47,932	199,876.44	0.16
182	000630	铜陵有色	31,324	199,220.64	0.16
183	601998	中信银行	28,500	197,505.00	0.16
184	000538	云南白药	4,122	195,259.14	0.15
185	300548	长芯博创	700	194,600.00	0.15
186	600015	华夏银行	30,412	194,332.68	0.15
187	601881	中国银河	15,453	194,244.21	0.15
188	600795	国电电力	41,559	194,080.53	0.15
189	601958	金钼股份	6,900	193,959.00	0.15
190	605499	东鹏饮料	1,568	193,538.24	0.15
191	600547	山东黄金	8,340	192,570.60	0.15
192	002202	金风科技	8,022	191,725.80	0.15
193	300498	温氏股份	15,558	191,674.56	0.15
194	000938	紫光股份	6,614	190,880.04	0.15
195	001389	广合科技	800	189,800.00	0.15
196	601669	中国电建	40,172	188,808.40	0.15
197	002050	三花智控	4,300	188,469.00	0.15
198	603893	瑞芯微	1,000	188,360.00	0.15
199	600104	上汽集团	19,251	187,889.76	0.15
200	300390	天华新能	2,000	187,020.00	0.15
201	300316	晶盛机电	3,049	184,159.60	0.15
202	002241	歌尔股份	8,167	184,002.51	0.15
203	002648	卫星化学	7,819	183,668.31	0.15
204	688110	东芯股份	900	183,330.00	0.15
205	601628	中国人寿	5,145	181,875.75	0.14
206	000807	云铝股份	8,194	181,415.16	0.14
207	300015	爱尔眼科	21,829	180,307.54	0.14
208	601179	中国西电	11,900	177,548.00	0.14
209	688271	联影医疗	1,745	176,646.35	0.14
210	688019	安集科技	520	176,519.20	0.14
211	688506	百利天恒	600	176,418.00	0.14
212	000301	东方盛虹	15,384	176,146.80	0.14
213	601838	成都银行	9,931	175,778.70	0.14
214	300395	菲利华	1,300	173,849.00	0.14
215	600026	中远海能	9,689	173,820.66	0.14
216	002049	紫光国微	1,947	172,796.25	0.14
217	002311	海大集团	3,826	170,677.86	0.14
218	601991	大唐发电	24,100	170,628.00	0.14
219	002185	华天科技	7,632	170,269.92	0.13
220	688002	睿创微纳	1,100	170,159.00	0.13
221	300751	迈为股份	600	169,476.00	0.13

222	601825	沪农商行	22,400	167,776.00	0.13
223	603228	景旺电子	2,300	166,543.00	0.13
224	000895	双汇发展	7,380	165,312.00	0.13
225	600958	东方证券	17,442	164,652.48	0.13
226	688036	传音控股	2,776	163,645.20	0.13
227	002027	分众传媒	33,793	163,558.12	0.13
228	000960	锡业股份	3,800	162,222.00	0.13
229	600674	川投能源	11,293	160,021.81	0.13
230	600436	片仔癀	1,461	159,658.08	0.13
231	600585	海螺水泥	9,340	158,313.00	0.13
232	688387	信科移动	7,900	156,736.00	0.12
233	600011	华能国际	20,518	155,731.62	0.12
234	301269	华大九天	1,300	155,246.00	0.12
235	002812	恩捷股份	2,300	153,893.00	0.12
236	601168	西部矿业	5,600	151,984.00	0.12
237	301358	湖南裕能	2,000	151,740.00	0.12
238	002625	光启技术	5,002	151,660.64	0.12
239	600115	中国东航	39,773	151,535.13	0.12
240	688027	国盾量子	300	151,203.00	0.12
241	601319	中国人保	22,210	150,139.60	0.12
242	300782	卓胜微	1,361	149,138.38	0.12
243	601231	环旭电子	4,600	149,040.00	0.12
244	000066	中国长城	7,526	143,370.30	0.11
245	601111	中国国航	23,590	142,719.50	0.11
246	603659	璞泰来	4,929	142,595.97	0.11
247	601360	三六零	16,312	141,751.28	0.11
248	300866	安克创新	1,350	141,075.00	0.11
249	002422	科伦药业	3,637	140,097.24	0.11
250	600066	宇通客车	5,200	139,412.00	0.11
251	000625	长安汽车	19,317	138,502.89	0.11
252	600601	方正科技	10,000	138,400.00	0.11
253	601901	方正证券	19,200	138,240.00	0.11
254	600418	江淮汽车	5,300	136,899.00	0.11
255	600029	南方航空	26,177	135,596.86	0.11
256	001979	招商蛇口	21,043	135,306.49	0.11
257	002304	洋河股份	3,546	135,279.90	0.11
258	000426	兴业银锡	4,100	135,136.00	0.11
259	600221	海航控股	100,100	135,135.00	0.11
260	000831	中国稀土	2,426	134,618.74	0.11
261	002736	国信证券	13,405	133,915.95	0.11
262	002653	海思科	2,000	132,680.00	0.11
263	601916	浙商银行	50,399	132,549.37	0.11
264	002414	高德红外	9,944	131,857.44	0.10

265	600895	张江高科	3,500	130,375.00	0.10
266	601788	光大证券	9,029	130,288.47	0.10
267	600415	小商品城	12,818	130,230.88	0.10
268	600048	保利发展	27,891	129,135.33	0.10
269	002595	豪迈科技	2,755	128,383.00	0.10
270	300803	指南针	1,400	128,338.00	0.10
271	600438	通威股份	10,553	127,796.83	0.10
272	600096	云天化	4,200	127,680.00	0.10
273	002236	大华股份	7,707	127,088.43	0.10
274	000783	长江证券	12,988	126,633.00	0.10
275	601877	正泰电器	5,051	126,628.57	0.10
276	601077	渝农商行	20,605	125,896.55	0.10
277	600233	圆通速递	7,952	125,244.00	0.10
278	688047	龙芯中科	800	123,736.00	0.10
279	002128	电投能源	5,275	121,958.00	0.10
280	601377	兴业证券	20,081	121,289.24	0.10
281	002558	巨人网络	4,400	121,264.00	0.10
282	000617	中油资本	18,200	119,938.00	0.10
283	600039	四川路桥	15,247	119,231.54	0.09
284	600580	卧龙电驱	3,600	119,160.00	0.09
285	600023	浙能电力	22,600	118,876.00	0.09
286	600426	华鲁恒升	4,961	118,667.12	0.09
287	002920	德赛西威	1,449	118,093.50	0.09
288	688578	艾力斯	1,080	117,936.00	0.09
289	300418	昆仑万维	2,900	117,044.00	0.09
290	002074	国轩高科	4,242	116,697.42	0.09
291	000157	中联重科	16,595	115,667.15	0.09
292	688187	时代电气	1,673	114,868.18	0.09
293	002532	天山铝业	10,696	114,768.08	0.09
294	600741	华域汽车	7,360	114,227.20	0.09
295	300058	蓝色光标	8,300	114,208.00	0.09
296	002850	科达利	600	113,580.00	0.09
297	688223	晶科能源	23,889	113,472.75	0.09
298	002129	TCL 中环	9,416	113,180.32	0.09
299	000963	华东医药	4,017	112,958.04	0.09
300	000933	神火股份	5,227	110,812.40	0.09
301	600196	复星医药	4,917	110,484.99	0.09
302	000975	山金国际	6,446	109,582.00	0.09
303	001965	招商公路	11,900	109,004.00	0.09
304	002064	华峰化学	11,486	109,002.14	0.09
305	601456	国联民生	12,237	108,175.08	0.09
306	001203	大中矿业	3,600	107,820.00	0.09
307	600219	南山铝业	26,914	107,386.86	0.09

308	300454	深信服	1,100	105,820.00	0.08
309	002379	宏桥控股	7,100	104,867.00	0.08
310	601021	春秋航空	2,300	104,834.00	0.08
311	601117	中国化学	14,244	104,693.40	0.08
312	688375	国博电子	1,000	104,300.00	0.08
313	688099	晶晨股份	998	102,694.20	0.08
314	603260	合盛硅业	2,123	102,455.98	0.08
315	600027	华电国际	23,000	102,350.00	0.08
316	301236	软通动力	2,400	101,880.00	0.08
317	300628	亿联网络	3,011	101,832.02	0.08
318	601198	东兴证券	7,490	101,789.10	0.08
319	601618	中国中冶	41,643	101,608.92	0.08
320	601878	浙商证券	10,603	100,728.50	0.08
321	603806	福斯特	5,973	100,286.67	0.08
322	002738	中矿资源	1,700	100,283.00	0.08
323	600988	赤峰黄金	3,800	100,016.00	0.08
324	601607	上海医药	6,491	99,961.40	0.08
325	300759	康龙化成	3,449	99,779.57	0.08
326	000559	万向钱潮	7,700	99,561.00	0.08
327	600642	申能股份	11,400	99,522.00	0.08
328	600021	上海电力	6,500	97,955.00	0.08
329	002555	三七互娱	5,181	97,765.47	0.08
330	600061	国投资本	14,900	97,595.00	0.08
331	601699	潞安环能	6,662	95,133.36	0.08
332	300919	中伟新材	2,174	95,112.50	0.08
333	600143	金发科技	6,100	94,245.00	0.07
334	601108	财通证券	10,780	93,247.00	0.07
335	600570	恒生电子	4,380	92,812.20	0.07
336	688188	柏楚电子	869	92,722.30	0.07
337	000688	国城矿业	2,700	92,421.00	0.07
338	002601	龙佰集团	5,586	92,057.28	0.07
339	600352	浙江龙盛	7,600	92,036.00	0.07
340	688472	阿特斯	8,452	91,450.64	0.07
341	688331	荣昌生物	700	91,182.00	0.07
342	601555	东吴证券	11,506	91,127.52	0.07
343	688122	西部超导	1,449	91,011.69	0.07
344	600918	中泰证券	17,011	90,498.52	0.07
345	300115	长盈精密	3,200	89,408.00	0.07
346	600803	新奥股份	5,644	89,175.20	0.07
347	601058	赛轮轮胎	7,631	87,985.43	0.07
348	601216	君正集团	19,725	87,973.50	0.07
349	002487	大金重工	1,500	86,955.00	0.07
350	601777	千里科技	10,600	86,496.00	0.07

351	000999	华润三九	3,834	86,226.66	0.07
352	002195	岩山科技	13,100	85,674.00	0.07
353	600600	青岛啤酒	1,628	85,030.44	0.07
354	002294	信立泰	2,617	83,456.13	0.07
355	300748	金力永磁	2,700	83,295.00	0.07
356	600845	宝信软件	4,950	82,318.50	0.07
357	600157	永泰能源	50,900	81,949.00	0.06
358	601696	中银证券	6,452	81,617.80	0.06
359	601577	长沙银行	9,369	81,603.99	0.06
360	300207	欣旺达	4,281	81,296.19	0.06
361	002517	恺英网络	5,000	81,250.00	0.06
362	002078	太阳纸业	6,450	80,560.50	0.06
363	603606	东方电缆	1,940	80,529.40	0.06
364	688303	大全能源	4,618	80,491.74	0.06
365	601212	白银有色	15,800	80,264.00	0.06
366	601162	天风证券	23,500	79,195.00	0.06
367	600711	盛屯矿业	7,200	78,984.00	0.06
368	688568	中科星图	1,900	78,793.00	0.06
369	002340	格林美	11,896	78,632.56	0.06
370	300832	新产业	1,863	78,246.00	0.06
371	000708	中信特钢	6,200	78,244.00	0.06
372	002939	长城证券	9,363	78,087.42	0.06
373	000728	国元证券	10,245	76,735.05	0.06
374	000983	山西焦煤	13,167	76,368.60	0.06
375	688599	天合光能	5,401	76,262.12	0.06
376	300765	石药创新	2,780	75,699.40	0.06
377	300251	光线传媒	6,800	75,412.00	0.06
378	002131	利欧股份	15,800	75,050.00	0.06
379	600839	四川长虹	10,700	74,686.00	0.06
380	000596	古井贡酒	931	74,293.80	0.06
381	002465	海格通信	5,800	74,066.00	0.06
382	600085	同仁堂	3,200	73,952.00	0.06
383	600515	海南机场	26,700	73,158.00	0.06
384	002966	苏州银行	10,500	73,080.00	0.06
385	600588	用友网络	7,955	73,026.90	0.06
386	603568	伟明环保	4,746	72,993.48	0.06
387	688617	惠泰医疗	401	72,805.56	0.06
388	603486	科沃斯	1,426	72,369.50	0.06
389	600733	北汽蓝谷	14,800	72,076.00	0.06
390	000786	北新建材	3,951	71,473.59	0.06
391	600298	安琪酵母	1,960	70,952.00	0.06
392	600009	上海机场	2,949	68,121.90	0.05
393	002252	上海莱士	15,428	66,957.52	0.05

394	000002	万 科 A	22,586	66,854.56	0.05
395	000876	新 希 望	10,568	66,261.36	0.05
396	300122	智飞生物	5,634	65,861.46	0.05
397	300413	芒果超媒	4,350	63,640.50	0.05
398	002459	晶澳科技	7,735	62,653.50	0.05
399	600536	中国软件	2,180	61,301.60	0.05
400	000661	长春高新	914	60,872.40	0.05
401	601933	永辉超市	21,200	60,208.00	0.05
402	300896	爱美客	670	58,424.00	0.05
403	601238	广汽集团	11,096	56,367.68	0.04
404	000564	供销大集	42,100	55,993.00	0.04
405	000932	华菱钢铁	15,968	55,408.96	0.04
406	603392	万泰生物	2,050	55,288.50	0.04
407	601799	星宇股份	610	55,278.20	0.04
408	601567	三星电气	3,300	49,302.00	0.04
409	300255	常山药业	2,100	49,182.00	0.04
410	300347	泰格医药	787	37,776.00	0.03

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

注：本基金本报告期期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,734,307.02	1.24
2	300308	中际旭创	1,122,470.00	0.80
3	002371	北方华创	650,841.00	0.46
4	300502	新易盛	636,295.00	0.45
5	000657	中钨高新	527,999.00	0.38
6	002475	立讯精密	509,387.00	0.36
7	002594	比亚迪	492,248.00	0.35
8	002384	东山精密	426,982.00	0.30
9	002916	深南电路	423,618.00	0.30
10	002602	世纪华通	421,336.00	0.30
11	300394	天孚通信	418,987.00	0.30
12	002851	麦格米特	350,658.00	0.25
13	000858	五 粮 液	344,260.00	0.25
14	300059	东方财富	342,189.00	0.24
15	300476	胜宏科技	327,142.00	0.23
16	300274	阳光电源	315,343.00	0.22
17	601869	长飞光纤	306,788.00	0.22
18	300136	信维通信	293,953.00	0.21
19	002379	宏桥控股	270,840.00	0.19

20	300475	香农芯创	266,141.00	0.19
----	--------	------	------------	------

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,699,623.00	1.92
2	300308	中际旭创	1,511,638.00	1.08
3	300502	新易盛	908,573.00	0.65
4	002371	北方华创	899,708.00	0.64
5	002594	比亚迪	802,849.00	0.57
6	002475	立讯精密	746,521.00	0.53
7	601138	工业富联	610,340.00	0.43
8	000858	五 粮 液	584,397.00	0.42
9	300394	天孚通信	563,795.00	0.40
10	002384	东山精密	558,829.00	0.40
11	300059	东方财富	536,338.00	0.38
12	002916	深南电路	518,999.00	0.37
13	300476	胜宏科技	504,457.00	0.36
14	300274	阳光电源	477,950.00	0.34
15	000333	美的集团	432,090.00	0.31
16	002938	鹏鼎控股	392,701.00	0.28
17	300033	同花顺	379,997.00	0.27
18	002142	宁波银行	364,989.00	0.26
19	002463	沪电股份	363,365.00	0.26
20	000001	平安银行	353,321.00	0.25

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	31,472,045.69
卖出股票收入（成交）总额	40,008,294.74

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	217,841.20
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	217,841.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
866	84,071.11	52,916,609.00	72.68	19,888,973.00	27.32

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	87,805,582.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	45,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	72,805,582.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
国泰海通	6	71,480,340.43	100.00	10,429.52	100.00	—
爱建证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东方财富	5	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国联民生证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
开源证券	2	—	—	—	—	—
联储证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	撤销 1 个 交易 单元
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
世纪证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西部证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	3	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
兴业证券	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	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—

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。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华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, 证券时报, 中国证券报	2026 年 1 月 5 日
2	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 1 月 21 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 变更场内简称、扩位简称的公告》	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	2026 年 2 月 13 日
5	《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	2026 年 2 月 13 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于增	本基金管理人网站, 中	2026 年 3 月 5 日

	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》	国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	
7	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026 年 3 月 28 日
8	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 3 月 28 日
9	《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	2026 年 4 月 17 日
10	《银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2026 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	2026 年 4 月 21 日
11	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2026 年 4 月 21 日
12	《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, 三大证券报	2026 年 5 月 9 日
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	2026 年 6 月 8 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260101-20260630	46,440,000.00	0.00	0.00	46,440,000.00	63.79
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华 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

12.1.2 《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》

12.1.3 《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》

12.1.4 《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》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2026 年 8 月 29 日