

# 银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)

## 2024 年中期报告

2024 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 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       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44        |
| 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      | 44        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 45        |
| 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 ..... | 45        |
| 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 .....    | 45        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 45        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 45        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 46        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 47        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>47</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 48        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 49        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>50</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 50        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 50        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 50        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称         | 银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称         | 银华深证 100 指数             |
| 场内简称         | 深证 100LOF               |
| 基金主代码        | 161812                  |
| 基金运作方式       | 契约型开放式                  |
| 基金合同生效日      | 2021 年 1 月 1 日          |
| 基金管理人        | 银华基金管理股份有限公司            |
| 基金托管人        | 中国民生银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额   | 309,904,179.66 份        |
| 基金合同存续期      | 不定期                     |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                 |
| 上市日期         | 2021 年 1 月 20 日         |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金运用指数化投资方式，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现深证 100 指数的有效跟踪，分享中国经济的持续、稳定增长的成果，实现基金资产的长期增值。   |
| 投资策略   | <p>本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0—3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%）。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> |
| 业绩比较基准 | $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税后)}$  |
| 风险收益特征 | 本基金为完全复制指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。  |

### 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               | 中国民生银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨文辉                        | 袁耀光                |
|             | 联系电话 | (010) 58163000             | 010-58560666       |
|             | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn         | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4006783333, (010) 85186558 | 95568              |

|       |                                |                  |
|-------|--------------------------------|------------------|
| 传真    | (010) 58163027                 | 010-57093382     |
| 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 2 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 2 号 |
| 邮政编码  | 100738                         | 100031           |
| 法定代表人 | 王珠林                            | 高迎欣              |

## 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》  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所   |

## 2.5 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -20,025,201.52                      |
| 本期利润          | -10,032,122.56                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0317                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.37%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -3.46%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 53,456,979.38                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1725                              |
| 期末基金资产净值      | 285,407,197.11                      |
| 期末基金份额净值      | 0.921                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | -40.73%                             |

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

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

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

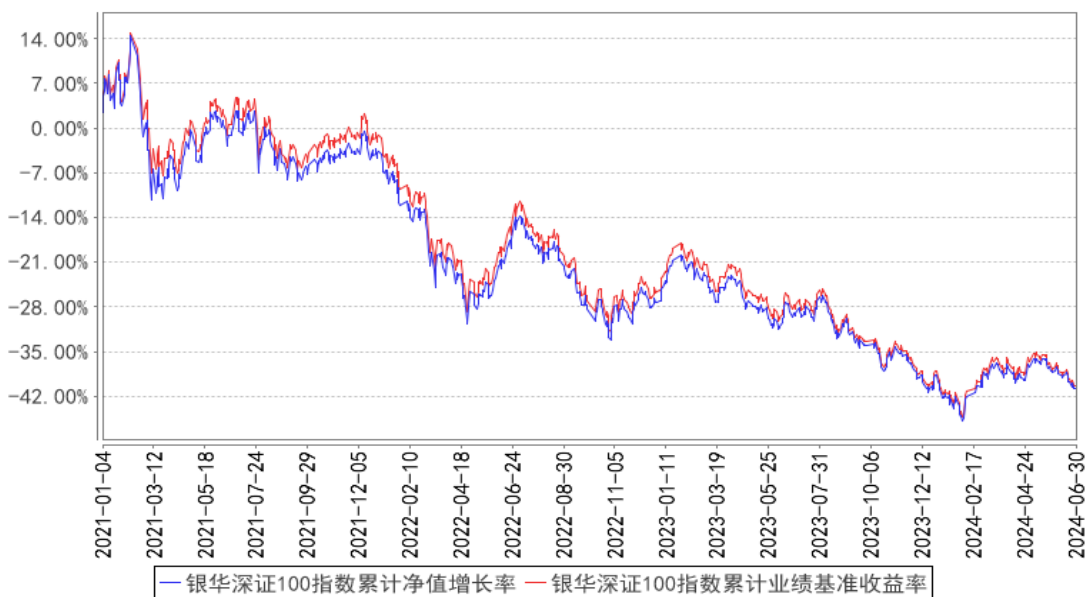
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -3.86%   | 0.66%       | -4.12%     | 0.68%         | 0.26%  | -0.02% |
| 过去三个月      | -3.56%   | 0.95%       | -4.40%     | 0.98%         | 0.84%  | -0.03% |
| 过去六个月      | -3.46%   | 1.12%       | -3.91%     | 1.13%         | 0.45%  | -0.01% |
| 过去一年       | -16.65%  | 1.04%       | -17.54%    | 1.05%         | 0.89%  | -0.01% |
| 过去三年       | -42.29%  | 1.19%       | -43.10%    | 1.19%         | 0.81%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | -40.73%  | 1.29%       | -40.38%    | 1.26%         | -0.35% | 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

银华深证100指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中权证资产占基金资产比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%）。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 214 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证  
券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优  
选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、  
银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券  
型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金  
(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用  
双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证  
券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、  
银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易  
货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、  
银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币  
市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合  
型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证  
券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、  
银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利  
灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证  
券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券  
型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混  
合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添  
益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华通利灵活



配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券

投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有

期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金、银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华新材料混合型发起式证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、银华晶鑫债券型证券投资基金、银华安泰债券型证券投资基金、银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 0-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银华盛泓债券型证券投资基金、银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金、银华钰祥债券型证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金、银华季季鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、银华富兴央企 6 个月封闭运作混合型发起式证券投资基金、银华月月鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金、银华嘉选平衡混合型发起式证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

|      |          | 任职日期           | 离任日期 |        |  |
|------|----------|----------------|------|--------|--|
| 张凯先生 | 本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 1 日 | -    | 14.5 年 | <p>硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 17 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 26 日至 2022 年 7 月 28 日兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2020 年 11 月 30 日起兼任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 2 月 23 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2021 年 5 月 13 日至 2022 年 6 月 17 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型</p> |

|      |          |                  |   |        |   |
|------|----------|------------------|---|--------|---|
|      |          |                  |   |        | 发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 19 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 杨腾先生 | 本基金的基金经理 | 2021 年 11 月 29 日 | - | 11.5 年 | 硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 11 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 11 月 29 日至 2023 年 3 月 16 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。  |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 5 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

上半年中，宏观经济运行整体上呈现一季度上行、二季度小幅回落的节奏。对比一、二季度的经济表现，我们能够看到一些与往年不同的特征：节假日消费与经济活动恢复良好，而非节假日期间的淡季特征则较为明显。这些特征显示出一些新的信息：从周期角度，商务活动的复苏落后于整体水平；而从更长远视角来看，伴随一系列结构性的变化，中国经济的消费属性权重正在增加。海外方面，美联储降息周期比预期有所推迟，海外利率水平依旧在高位维持。在上述因素的作用下，A 股市场各主要宽基指数在上半年中涨跌互现。行业层面，银行、煤炭、石油石化等行业表现领先，消费者服务、计算机、商贸零售等行业表现落后。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.921 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.46%，业绩比较基准收益率为-3.91%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，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，宏观政策、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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金

的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 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：银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 18,379,160.39          | 19,954,451.53            |
| 结算备付金      |         | -                      | -                        |
| 存出保证金      |         | 2,451.94               | 1,761.05                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 267,645,644.59         | 287,915,180.83           |
| 其中：股票投资    |         | 267,645,644.59         | 287,915,180.83           |
| 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      |         | 7,994.18               | 10,401.77                |
| 递延所得税资产    |         | -                      | -                        |
| 其他资产       | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计       |         | 286,035,251.10         | 307,881,795.18           |



| 负债和净资产      | 附注号      | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------|------------------------|--------------------------|
| <b>负 债：</b> |          |                        |                          |
| 短期借款        |          | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |          | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3  | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |          | -                      | -                        |
| 应付清算款       |          | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |          | 44,068.73              | 2,750.25                 |
| 应付管理人报酬     |          | 241,194.04             | 258,627.90               |
| 应付托管费       |          | 48,238.81              | 51,725.58                |
| 应付销售服务费     |          | -                      | -                        |
| 应付投资顾问费     |          | -                      | -                        |
| 应交税费        |          | -                      | -                        |
| 应付利润        |          | -                      | -                        |
| 递延所得税负债     |          | -                      | -                        |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 294,552.41             | 335,543.85               |
| 负债合计        |          | 628,053.99             | 648,647.58               |
| <b>净资产：</b> |          |                        |                          |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 231,950,217.73         | 241,160,471.90           |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -                      | -                        |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 53,456,979.38          | 66,072,675.70            |
| 净资产合计       |          | 285,407,197.11         | 307,233,147.60           |
| 负债和净资产总计    |          | 286,035,251.10         | 307,881,795.18           |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.921 元，基金份额总额 309,904,179.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |          | -8,161,011.75                            | -5,039,451.63                                 |
| 1. 利息收入        |          | 32,990.55                                | 44,629.42                                     |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 32,990.55                                | 44,629.42                                     |
| 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）               |            | -18,203,166.49 | -3,150,821.35 |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | -22,017,927.23 | -6,665,299.90 |
| 基金投资收益                          |            | -              | -             |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | -              | -             |
| 资产支持证券投资<br>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   | -              | -             |
| 股利收益                            | 6.4.7.19   | 3,814,760.74   | 3,514,478.55  |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益   |            | -              | -             |
| 其他投资收益                          |            | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.20   | 9,993,078.96   | -1,948,791.92 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |            | -              | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.21   | 16,085.23      | 15,532.22     |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 1,871,110.81   | 2,410,904.23  |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 1,480,783.72   | 1,928,728.19  |
| 其中：暂估管理人报酬                      |            | -              | -             |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 296,156.73     | 385,745.59    |
| 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<br>支出               |            | -              | -             |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -              | -             |
| 7. 税金及附加                        |            | -              | -             |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | 94,170.36      | 96,430.45     |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | -10,032,122.56 | -7,450,355.86 |
| 减：所得税费用                         |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | -10,032,122.56 | -7,450,355.86 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | -              | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | -10,032,122.56 | -7,450,355.86 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日      |        |                |                |
|--|--|--------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 241,160,471.90                             | -      | 66,072,675.70  | 307,233,147.60 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 241,160,471.90                             | -      | 66,072,675.70  | 307,233,147.60 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -9,210,254.17                              | -      | -12,615,696.32 | -21,825,950.49 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -10,032,122.56 | -10,032,122.56 |
| (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)      | -9,210,254.17                              | -      | -2,583,573.76  | -11,793,827.93 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,319,353.75                               | -      | 580,616.71     | 2,899,970.46   |
| 2. 基金赎回款                                 | -11,529,607.92                             | -      | -3,164,190.47  | -14,693,798.39 |
| (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                                | 231,950,217.73                             | -      | 53,456,979.38  | 285,407,197.11 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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                                  | 260,715,896.19                             | -      | 133,224,325.18 | 393,940,221.37 |

|  |                |   |                |                |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 资产                                       |                |   |                |                |
| 加：会计政策变更                                 | -              | - | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -              | - | -              | -              |
| 其他                                       | -              | - | -              | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 260,715,896.19 | - | 133,224,325.18 | 393,940,221.37 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -14,287,299.09 | - | -15,759,017.00 | -30,046,316.09 |
| (一)、综合收益总额                               | -              | - | -7,450,355.86  | -7,450,355.86  |
| (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)      | -14,287,299.09 | - | -8,308,661.14  | -22,595,960.23 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,308,534.41   | - | 698,299.02     | 2,006,833.43   |
| 2. 基金赎回款                                 | -15,595,833.50 | - | -9,006,960.16  | -24,602,793.66 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -              | - | -              | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -              | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 246,428,597.10 | - | 117,465,308.18 | 363,893,905.28 |

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

银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 由银华深证 100 指数分级证券投资基金转型而成, 原基金系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可 [2010]302 号文《关于核准银华深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》的核准, 由银华基金管理股份有限公司于 2010 年 4 月 1 日至 2010 年 4 月 30 日向社会公开募集, 首次募集规模为 2,203,888,365.95 份基金份额。基金合同于 2010 年 5 月 7 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。根据 2020 年 12 月 2 日《关于银华深证 100 指数分级证券投资基金之银华稳进份额和银华锐进份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》转型为本基金。基金托管人与注册登记机构不变。《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效, 转型后的基金按照《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的相关约定进行运作。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括深证 100 指数的成份股、备选成份股、新股 (首次公开发行或增发)、存托凭证、债券、债券回购以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%, 其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10% (其中权证资产占基金资产比例为 0—3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%)。其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:  $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税后)}$ 。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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”) 编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关

规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### 6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

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

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 18,379,160.39          |
| 等于：本金          | 18,377,404.67          |
| 加：应计利息         | 1,755.72               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 18,379,160.39          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元



| 项目                | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |      |                |                 |
|-------------------|------------------------|------|----------------|-----------------|
|                   | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动          |
| 股票                | 383,685,247.92         | -    | 267,645,644.59 | -116,039,603.33 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 383,685,247.92         | -    | 267,645,644.59 | -116,039,603.33 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 28.11             |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 7,661.19          |
| 其中：交易所市场    | 7,661.19          |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 134,535.36        |
| 其他          | 152,327.75        |
| 合计          | 294,552.41        |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 322,210,620.43             | 241,160,471.90 |
| 本期申购          | 3,098,817.82               | 2,319,353.75   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,405,258.59             | -11,529,607.92 |
| 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 | 309,904,179.66 | 231,950,217.73 |
|-----|----------------|----------------|

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末           | 706,199,381.99 | -640,126,706.29 | 66,072,675.70  |
| 加：会计政策变更       | -              | -               | -              |
| 前期差错更正         | -              | -               | -              |
| 其他             | -              | -               | -              |
| 本期期初           | 706,199,381.99 | -640,126,706.29 | 66,072,675.70  |
| 本期利润           | -20,025,201.52 | 9,993,078.96    | -10,032,122.56 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -26,850,887.00 | 24,267,313.24   | -2,583,573.76  |
| 其中：基金申购款       | 6,769,042.56   | -6,188,425.85   | 580,616.71     |
| 基金赎回款          | -33,619,929.56 | 30,455,739.09   | -3,164,190.47  |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -              |
| 本期末            | 659,323,293.47 | -605,866,314.09 | 53,456,979.38  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 32,870.39                  |
| 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 | 102.28    |
| 其他        | 17.88     |
| 合计        | 32,990.55 |

#### 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -22,017,927.23       |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                    |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                    |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                    |
| 合计               | -22,017,927.23       |

##### 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 21,966,015.63        |
| 减：卖出股票成本总额 | 43,955,189.15        |
| 减：交易费用     | 28,753.71            |
| 买卖股票差价收入   | -22,017,927.23       |

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,814,760.74               |
| 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            | 3,814,760.74               |

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 9,993,078.96               |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 股票投资                   | 9,993,078.96 |
| 债券投资                   | -            |
| 资产支持证券投资               | -            |
| 基金投资                   | -            |
| 贵金属投资                  | -            |
| 其他                     | -            |
| 2. 衍生工具                | -            |
| 权证投资                   | -            |
| 3. 其他                  | -            |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -            |
| 合计                     | 9,993,078.96 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 16,085.23                  |
| 合计      | 16,085.23                  |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 24,863.02                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 35.00                      |
| 账户维护费   | 9,600.00                   |
| 合计      | 94,170.36                  |

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系      |
|------------------------|--------------|
| 银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）   | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,480,783.72                          | 1,928,728.19                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 232,772.33                            | 286,719.08                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,248,011.39                          | 1,642,009.11                               |

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

$$H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 296,156.73                               | 385,745.59                                    |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元



| 关联方名称  | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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    |
| 中国民生银行 | 18,379,160.39                         | 32,870.39 | 23,857,341.26                              | 44,451.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |      |        |       |        |          |          |           |    |
|----------------------|------|-----------------|------|--------|-------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 受限期  | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额   | 期末估值总额    | 备注 |
| 301580               | 爱迪特  | 2024 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 44.95 | 65.93  | 186      | 8,360.70 | 12,262.98 | -  |

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资品种符合合同规定，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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<br>2024 年 6 月 30 日   | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息             | 合计             |
|--------------------------|---------------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 资产                       |               |       |       |                 |                |
| 货币资金                     | 18,379,160.39 | -     | -     | -               | 18,379,160.39  |
| 存出保证金                    | 2,451.94      | -     | -     | -               | 2,451.94       |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | -267,645,644.59 | 267,645,644.59 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 7,994.18        | 7,994.18       |
| 资产总计                     | 18,381,612.33 | -     | -     | -267,653,638.77 | 286,035,251.10 |
| 负债                       |               |       |       |                 |                |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 44,068.73       | 44,068.73      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 241,194.04      | 241,194.04     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 48,238.81       | 48,238.81      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 294,552.41      | 294,552.41     |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 628,053.99      | 628,053.99     |
| 利率敏感度缺口                  | 18,381,612.33 | -     | -     | -267,025,584.78 | 285,407,197.11 |
| 上年度末<br>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    | 19,954,451.53 | - | - | -               | 19,954,451.53  |
| 存出保证金   | 1,761.05      | - | - | -               | 1,761.05       |
| 交易性金融资产 | -             | - | - | -287,915,180.83 | 287,915,180.83 |
| 应收申购款   | -             | - | - | 10,401.77       | 10,401.77      |
| 资产总计    | 19,956,212.58 | - | - | -287,925,582.60 | 307,881,795.18 |
| 负债      |               |   |   |                 |                |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 2,750.25        | 2,750.25       |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 258,627.90      | 258,627.90     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 51,725.58       | 51,725.58      |
| 其他负债    | -             | - | - | 335,543.85      | 335,543.85     |
| 负债总计    | -             | - | - | 648,647.58      | 648,647.58     |
| 利率敏感度缺口 | 19,956,212.58 | - | - | -287,276,935.02 | 307,233,147.60 |

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：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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<br>2024年6月30日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|--------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|              | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 267,645,644.59    | 93.78            | 287,915,180.83      | 93.71            |

|               |                |       |                |       |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 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            | 267,645,644.59 | 93.78 | 287,915,180.83 | 93.71 |

#### 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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%                                      | 13,980,789.10               | 15,045,515.49          |
|    | 业绩比较基准下降 5%                                      | -13,980,789.10              | -15,045,515.49         |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 267,633,381.61         | 287,681,055.67           |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | 12,262.98              | 234,125.16               |
| 合计            | 267,645,644.59         | 287,915,180.83           |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 267,645,644.59 | 93.57         |
|    | 其中：股票  | 267,645,644.59 | 93.57         |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | -              | -             |
|    | 其中：债券  | -              | -             |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 18,379,160.39  | 6.43   |
| 8 | 其他各项资产            | 10,446.12      | 0.00   |
| 9 | 合计                | 286,035,251.10 | 100.00 |

## 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         | 10,341,932.24  | 3.62         |
| B  | 采矿业              | 1,242,355.00   | 0.44         |
| C  | 制造业              | 210,520,504.46 | 73.76        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,661,615.34   | 0.58         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 1,011,199.41   | 0.35         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,594,023.32   | 1.61         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,217,605.50   | 2.53         |
| J  | 金融业              | 20,293,911.06  | 7.11         |
| K  | 房地产业             | 3,474,934.92   | 1.22         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,921,841.12   | 1.02         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,073,478.62   | 0.73         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,133,907.68   | 0.75         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 267,487,308.67 | 93.72        |

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 157,575.53 | 0.06         |
| 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  | 760.39     | 0.00         |
| 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       | -          | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -          | -            |
| P  | 教育               | -          | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -          | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -          | -            |
| S  | 综合               | -          | -            |
|    | 合计               | 158,335.92 | 0.06         |

### 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 | 124,418 | 22,398,972.54 | 7.85         |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 232,022 | 14,965,419.00 | 5.24         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 86,420  | 11,065,216.80 | 3.88         |
| 4  | 002594 | 比亚迪  | 42,243  | 10,571,310.75 | 3.70         |
| 5  | 002475 | 立讯精密 | 221,961 | 8,725,286.91  | 3.06         |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 212,990 | 8,353,467.80  | 2.93         |



|    |        |        |           |              |      |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 7  | 300760 | 迈瑞医疗   | 25,509    | 7,420,823.19 | 2.60 |
| 8  | 300059 | 东方财富   | 598,276   | 6,317,794.56 | 2.21 |
| 9  | 000725 | 京东方 A  | 1,517,506 | 6,206,599.54 | 2.17 |
| 10 | 300308 | 中际旭创   | 43,040    | 5,934,355.20 | 2.08 |
| 11 | 002415 | 海康威视   | 180,573   | 5,581,511.43 | 1.96 |
| 12 | 002714 | 牧原股份   | 119,184   | 5,196,422.40 | 1.82 |
| 13 | 300498 | 温氏股份   | 259,612   | 5,145,509.84 | 1.80 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖   | 35,814    | 5,138,950.86 | 1.80 |
| 15 | 300124 | 汇川技术   | 91,800    | 4,709,340.00 | 1.65 |
| 16 | 002371 | 北方华创   | 13,479    | 4,311,797.31 | 1.51 |
| 17 | 300274 | 阳光电源   | 68,719    | 4,262,639.57 | 1.49 |
| 18 | 000063 | 中兴通讯   | 152,315   | 4,260,250.55 | 1.49 |
| 19 | 000001 | 平安银行   | 404,571   | 4,106,395.65 | 1.44 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力   | 243,892   | 3,960,806.08 | 1.39 |
| 21 | 002230 | 科大讯飞   | 87,632    | 3,763,794.40 | 1.32 |
| 22 | 000100 | TCL 科技 | 868,689   | 3,752,736.48 | 1.31 |
| 23 | 002352 | 顺丰控股   | 104,628   | 3,734,173.32 | 1.31 |
| 24 | 002142 | 宁波银行   | 163,553   | 3,607,979.18 | 1.26 |
| 25 | 000792 | 盐湖股份   | 185,657   | 3,239,714.65 | 1.14 |
| 26 | 002027 | 分众传媒   | 482,152   | 2,921,841.12 | 1.02 |
| 27 | 000625 | 长安汽车   | 205,756   | 2,763,303.08 | 0.97 |
| 28 | 000425 | 徐工机械   | 367,714   | 2,629,155.10 | 0.92 |
| 29 | 300014 | 亿纬锂能   | 60,709    | 2,423,503.28 | 0.85 |
| 30 | 002463 | 沪电股份   | 65,200    | 2,379,800.00 | 0.83 |
| 31 | 002304 | 洋河股份   | 28,636    | 2,312,070.64 | 0.81 |
| 32 | 002241 | 歌尔股份   | 116,074   | 2,264,603.74 | 0.79 |
| 33 | 300015 | 爱尔眼科   | 206,774   | 2,133,907.68 | 0.75 |
| 34 | 000002 | 万 科 A  | 293,396   | 2,033,234.28 | 0.71 |
| 35 | 002179 | 中航光电   | 53,262    | 2,026,619.10 | 0.71 |
| 36 | 002050 | 三花智控   | 98,767    | 1,884,474.36 | 0.66 |
| 37 | 000538 | 云南白药   | 36,703    | 1,877,358.45 | 0.66 |
| 38 | 000938 | 紫光股份   | 83,645    | 1,869,465.75 | 0.66 |
| 39 | 000977 | 浪潮信息   | 50,000    | 1,818,500.00 | 0.64 |
| 40 | 000166 | 申万宏源   | 421,264   | 1,815,647.84 | 0.64 |
| 41 | 002311 | 海大集团   | 37,489    | 1,763,857.45 | 0.62 |
| 42 | 300408 | 三环集团   | 59,840    | 1,746,729.60 | 0.61 |
| 43 | 002252 | 上海莱士   | 223,200   | 1,745,424.00 | 0.61 |
| 44 | 300433 | 蓝思科技   | 93,497    | 1,706,320.25 | 0.60 |
| 45 | 000776 | 广发证券   | 135,526   | 1,649,351.42 | 0.58 |
| 46 | 000157 | 中联重科   | 214,598   | 1,648,112.64 | 0.58 |
| 47 | 002049 | 紫光国微   | 31,229    | 1,642,645.40 | 0.58 |
| 48 | 003816 | 中国广核   | 333,918   | 1,546,040.34 | 0.54 |
| 49 | 300122 | 智飞生物   | 54,433    | 1,525,756.99 | 0.53 |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 50 | 002460 | 赣锋锂业   | 53,019  | 1,518,994.35 | 0.53 |
| 51 | 000768 | 中航西飞   | 62,217  | 1,495,074.51 | 0.52 |
| 52 | 002648 | 卫星化学   | 82,900  | 1,490,542.00 | 0.52 |
| 53 | 002466 | 天齐锂业   | 49,400  | 1,477,554.00 | 0.52 |
| 54 | 000596 | 古井贡酒   | 6,928   | 1,462,292.96 | 0.51 |
| 55 | 001979 | 招商蛇口   | 164,016 | 1,441,700.64 | 0.51 |
| 56 | 002001 | 新和成    | 73,344  | 1,408,204.80 | 0.49 |
| 57 | 002601 | 龙佰集团   | 74,487  | 1,383,223.59 | 0.48 |
| 58 | 002493 | 荣盛石化   | 143,100 | 1,382,346.00 | 0.48 |
| 59 | 002236 | 大华股份   | 89,340  | 1,381,196.40 | 0.48 |
| 60 | 000661 | 长春高新   | 14,465  | 1,327,453.05 | 0.47 |
| 61 | 000786 | 北新建材   | 43,715  | 1,296,586.90 | 0.45 |
| 62 | 300418 | 昆仑万维   | 39,200  | 1,263,808.00 | 0.44 |
| 63 | 300782 | 卓胜微    | 16,182  | 1,257,988.68 | 0.44 |
| 64 | 300347 | 泰格医药   | 25,652  | 1,246,687.20 | 0.44 |
| 65 | 000983 | 山西焦煤   | 120,500 | 1,242,355.00 | 0.44 |
| 66 | 300661 | 圣邦股份   | 14,917  | 1,234,829.26 | 0.43 |
| 67 | 002938 | 鹏鼎控股   | 30,490  | 1,212,282.40 | 0.42 |
| 68 | 000895 | 双汇发展   | 50,998  | 1,212,222.46 | 0.42 |
| 69 | 002129 | TCL 中环 | 139,676 | 1,208,197.40 | 0.42 |
| 70 | 002180 | 纳思达    | 44,500  | 1,175,690.00 | 0.41 |
| 71 | 002271 | 东方雨虹   | 94,115  | 1,161,379.10 | 0.41 |
| 72 | 002736 | 国信证券   | 131,521 | 1,142,917.49 | 0.40 |
| 73 | 300896 | 爱美客    | 6,605   | 1,136,720.50 | 0.40 |
| 74 | 002920 | 德赛西威   | 11,995  | 1,044,644.55 | 0.37 |
| 75 | 300832 | 新产业    | 15,400  | 1,038,576.00 | 0.36 |
| 76 | 000963 | 华东医药   | 36,361  | 1,011,199.41 | 0.35 |
| 77 | 002709 | 天赐材料   | 57,281  | 1,005,854.36 | 0.35 |
| 78 | 300033 | 同花顺    | 9,590   | 994,483.00   | 0.35 |
| 79 | 000999 | 华润三九   | 23,100  | 983,598.00   | 0.34 |
| 80 | 002916 | 深南电路   | 9,185   | 971,497.45   | 0.34 |
| 81 | 002459 | 晶澳科技   | 86,366  | 967,299.20   | 0.34 |
| 82 | 000301 | 东方盛虹   | 118,808 | 946,899.76   | 0.33 |
| 83 | 000876 | 新希望    | 101,716 | 929,684.24   | 0.33 |
| 84 | 002555 | 三七互娱   | 70,286  | 917,232.30   | 0.32 |
| 85 | 001965 | 招商公路   | 72,500  | 859,850.00   | 0.30 |
| 86 | 300316 | 晶盛机电   | 29,198  | 838,858.54   | 0.29 |
| 87 | 300759 | 康龙化成   | 44,499  | 826,791.42   | 0.29 |
| 88 | 300628 | 亿联网络   | 21,701  | 797,945.77   | 0.28 |
| 89 | 300450 | 先导智能   | 46,871  | 779,464.73   | 0.27 |
| 90 | 002812 | 恩捷股份   | 23,651  | 748,554.15   | 0.26 |
| 91 | 300999 | 金龙鱼    | 26,944  | 736,918.40   | 0.26 |
| 92 | 002821 | 凯莱英    | 10,474  | 689,189.20   | 0.24 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 93  | 000617 | 中油资本 | 119,446 | 659,341.92 | 0.23 |
| 94  | 301269 | 华大九天 | 8,500   | 654,925.00 | 0.23 |
| 95  | 300413 | 芒果超媒 | 29,562  | 617,845.80 | 0.22 |
| 96  | 002603 | 以岭药业 | 37,500  | 574,875.00 | 0.20 |
| 97  | 000708 | 中信特钢 | 40,518  | 549,829.26 | 0.19 |
| 98  | 300979 | 华利集团 | 7,300   | 444,205.00 | 0.16 |
| 99  | 000877 | 天山股份 | 67,210  | 362,934.00 | 0.13 |
| 100 | 001289 | 龙源电力 | 6,700   | 115,575.00 | 0.04 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 301580 | 爱迪特  | 1,857 | 141,264.18 | 0.05         |
| 2  | 300751 | 迈为股份 | 80    | 9,558.40   | 0.00         |
| 3  | 300957 | 贝泰妮  | 70    | 3,382.40   | 0.00         |
| 4  | 300919 | 中伟股份 | 56    | 1,735.44   | 0.00         |
| 5  | 300142 | 沃森生物 | 84    | 955.92     | 0.00         |
| 6  | 002841 | 视源股份 | 23    | 679.19     | 0.00         |
| 7  | 002410 | 广联达  | 53    | 507.74     | 0.00         |
| 8  | 300454 | 深信服  | 5     | 252.65     | 0.00         |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1  | 002463 | 沪电股份   | 2,352,702.00 | 0.77           |
| 2  | 000977 | 浪潮信息   | 1,781,434.00 | 0.58           |
| 3  | 002252 | 上海莱士   | 1,679,157.00 | 0.55           |
| 4  | 002648 | 卫星化学   | 1,521,662.00 | 0.50           |
| 5  | 300418 | 昆仑万维   | 1,208,779.00 | 0.39           |
| 6  | 300832 | 新产业    | 1,052,814.00 | 0.34           |
| 7  | 000999 | 华润三九   | 989,705.00   | 0.32           |
| 8  | 000100 | TCL 科技 | 594,588.00   | 0.19           |
| 9  | 300760 | 迈瑞医疗   | 433,075.00   | 0.14           |
| 10 | 001965 | 招商公路   | 348,999.00   | 0.11           |
| 11 | 001979 | 招商蛇口   | 222,439.00   | 0.07           |
| 12 | 000301 | 东方盛虹   | 178,360.00   | 0.06           |
| 13 | 000425 | 徐工机械   | 172,408.00   | 0.06           |
| 14 | 002466 | 天齐锂业   | 126,151.00   | 0.04           |
| 15 | 300308 | 中际旭创   | 114,195.04   | 0.04           |
| 16 | 300759 | 康龙化成   | 108,602.00   | 0.04           |
| 17 | 300896 | 爱美客    | 95,866.00    | 0.03           |
| 18 | 002371 | 北方华创   | 90,491.00    | 0.03           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 19 | 301580 | 爱迪特  | 83,472.15 | 0.03 |
| 20 | 002920 | 德赛西威 | 64,905.76 | 0.02 |

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  | 000333 | 美的集团  | 1,058,297.00 | 0.34           |
| 2  | 000858 | 五粮液   | 1,025,373.00 | 0.33           |
| 3  | 300142 | 沃森生物  | 978,181.00   | 0.32           |
| 4  | 300751 | 迈为股份  | 919,139.00   | 0.30           |
| 5  | 300750 | 宁德时代  | 867,890.00   | 0.28           |
| 6  | 300919 | 中伟股份  | 684,200.00   | 0.22           |
| 7  | 002410 | 广联达   | 677,346.00   | 0.22           |
| 8  | 300454 | 深信服   | 609,141.00   | 0.20           |
| 9  | 300059 | 东方财富  | 595,556.00   | 0.19           |
| 10 | 000651 | 格力电器  | 575,485.00   | 0.19           |
| 11 | 000725 | 京东方 A | 538,757.00   | 0.18           |
| 12 | 002841 | 视源股份  | 516,994.00   | 0.17           |
| 13 | 002415 | 海康威视  | 465,840.00   | 0.15           |
| 14 | 002352 | 顺丰控股  | 443,702.00   | 0.14           |
| 15 | 000568 | 泸州老窖  | 395,389.00   | 0.13           |
| 16 | 300124 | 汇川技术  | 360,391.00   | 0.12           |
| 17 | 002475 | 立讯精密  | 355,815.00   | 0.12           |
| 18 | 300308 | 中际旭创  | 351,459.60   | 0.11           |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗  | 349,727.00   | 0.11           |
| 20 | 300498 | 温氏股份  | 322,979.00   | 0.11           |

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 | 13,692,573.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 21,966,015.63 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 2,451.94  |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 7,994.18  |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 10,446.12 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 301580 | 爱迪特  | 12,262.98   | 0.00          | 新股流通受限   |

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 18,484       | 16,766.08     | 6,906,411.71 | 2.23       | 302,997,767.95 | 97.77      |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                  | 持有份额 (份)     | 占上市总份额比例 (%) |
|----|------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 甘丽                     | 5,896,543.00 | 2.43         |
| 2  | 杨东宁                    | 4,499,103.00 | 1.85         |
| 3  | 王晓松                    | 3,773,617.00 | 1.55         |
| 4  | 吴巧芬                    | 2,655,513.00 | 1.09         |
| 5  | 徐国忠                    | 2,562,570.00 | 1.05         |
| 6  | 沈中坚                    | 2,536,183.00 | 1.04         |
| 7  | 陈美龄                    | 2,257,186.00 | 0.93         |
| 8  | 信达证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户 | 2,180,385.00 | 0.90         |
| 9  | 尹红英                    | 2,153,356.00 | 0.89         |
| 10 | 刘国敬                    | 1,988,183.00 | 0.82         |

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 21,173.94  | 0.01         |

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 1 月 1 日）基金份额总额 | 1,603,165,108.43 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 322,210,620.43   |
| 本报告期基金总申购份额                   | 3,098,817.82     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 15,405,258.59    |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                |
| 本报告期末基金份额总额                   | 309,904,179.66   |

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 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、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 民生证券   | 1      | 35,575,117.43 | 100.00           | 15,487.78 | 100.00         | -  |
| 光大证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国投证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国信证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 海通证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华林证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 江海证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 申万宏源   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 万联证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 信达证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 银河证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 英大证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 浙商证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 中金财富证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 中信浙江   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 中银国际   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |       | 债券回购交易 |            | 权证交易 |       |
|------|------|-------|--------|------------|------|-------|
|      | 成交金额 | 占当期债券 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总 | 成交金额 | 占当期权证 |
|      |      | 券     |        | 成交总        |      | 证     |



|            |   | 成交总额<br>的比例 (%) |   | 额的比例 (%) |   | 成交总额<br>的比例 (%) |
|------------|---|-----------------|---|----------|---|-----------------|
| 民生证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 光大证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 国投证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 国信证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 海通证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 华林证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 江海证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 申万宏<br>源   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 万联证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 信达证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 银河证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 英大证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 浙商证<br>券   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 中金财<br>富证券 | - | -               | - | -        | - | -               |
| 中信浙<br>江   | - | -               | - | -        | - | -               |
| 中银国<br>际   | - | -               | - | -        | - | -               |

### 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  | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 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  | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 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   | 2024 年 3 月 29 日 |

|   |  | 网站                      |                 |
|---|--|-------------------------|-----------------|
| 4 | 《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 |
| 5 | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 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 |
| 6 | 《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 |
| 7 | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新》           | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 5 月 10 日 |
| 8 | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 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 5 月 10 日 |
| 9 | 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新》           | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 28 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华深证 100 指数分级证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 12.1.3 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》
- 12.1.4 《银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日