

银华深证 100 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2020 年中期报告

2020 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
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.....	15
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.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 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 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.....	44
7.8 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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
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的情况.....	46
<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>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
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 .....	51
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深 100P
场内简称	深 100P
基金主代码	159969
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 28 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	63,903,014.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 8 月 28 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	<p>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而进行相应调整。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为深证 100 指数，指数代码为：399330。
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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王健

	联系电话	(010) 58163000	021-38676252
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	021-38917599-5
传真		(010) 58163027	021-38677819
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	中国（上海）自由贸易试验区商 城路 618 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码		100738	200041
法定代表人		王珠林	贺青

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	11,018,860.08
本期利润	10,605,555.86
加权平均基金份额本期利润	0.1056
本期加权平均净值利润率	9.05%
本期基金份额净值增长率	14.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	15,772,019.77
期末可供分配基金份额利润	0.2468
期末基金资产净值	83,808,492.89
期末基金份额净值	1.3115
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	31.15%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人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

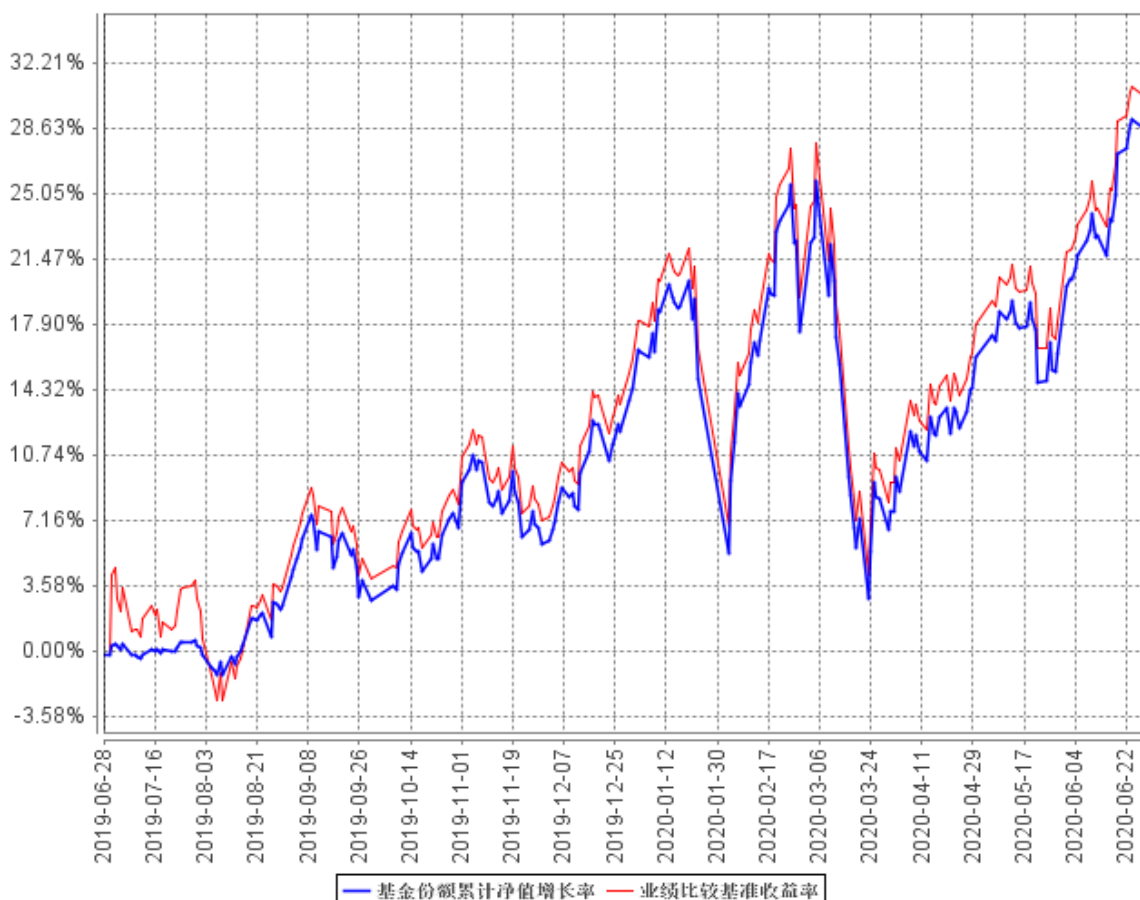
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.82%	1.01%	12.77%	1.04%	0.05%	-0.03%
过去三个月	21.83%	1.06%	21.83%	1.08%	0.00%	-0.02%
过去六个月	14.61%	1.76%	14.71%	1.79%	-0.10%	-0.03%
过去一年	31.39%	1.34%	33.38%	1.45%	-1.99%	-0.11%
自基金合同生效起至今	31.15%	1.33%	33.08%	1.44%	-1.93%	-0.11%



### 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

基金份额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



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

## § 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%，山西海鑫实业股份有限公司 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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 130 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、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、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、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)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、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分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财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、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、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）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、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、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车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、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、银华文体娱乐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、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、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、银华智荟分红收益灵活配置混合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、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、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、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华安享短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券

投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、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。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	2019 年 6 月 28 日	-	10.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起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日起兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理,自2019年6月28日起兼任银华深证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日起兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理,自2019年12月6日起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。具有从业资格。国籍:中国。
王帅先生	本基金的基金经理	2019年6月28日	-	7.5年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司,2018年8月加入银华基金,历任量化投资部基金经理助理,现任量化投资部基金经理。自2019年6月28日起兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2019年11月1日起兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2019年12月6日起兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2020年1月22日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2020年3月20日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2020年5月28日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。

张亦驰先生	本基金的基金经理助理	2019年6月28日	-	5年	硕士学位，曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015年10月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2019年6月28日	-	8.5年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012年8月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
刘文魁先生	本基金的基金经理助理	2019年7月15日	-	6年	硕士学位。曾就职于艾派迪财团、佛罗里达大学商学院、华夏基金管理有限公司。2015年5月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，现任基金经理助理。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之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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 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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管

理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 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 1 次，原因是指数型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

2020 年上半年，新冠疫情在全球范围持续扩散，并对当前的全球市场经济造成了巨大冲击。截止 6 月底，全球累计确诊人数约为 1000 万。疫情的扩散正在重塑全球的经济、市场格局。与海外相比，我国国内的疫情防控水平显著优秀。疫情的控制和复工复产的进程也极大的鼓舞了民众的信心，A 股市场也在上半年中表现优良，各主要指数均有明显涨幅。

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 1.3115 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.61%，业绩比较基准收益率为 14.71%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.20%之内，年化跟踪误差控制在 2%之内。

### 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 2020 年下半年，我们对市场持谨慎乐观态度。疫情在海外国家的控制情况仍是全球市场的核心变量，也将反过来影响 A 股市场的情绪与资金流向。在国内疫情控制得力的背景下，国内资产在全球配置中的吸引力抬升，加之下半年的复工复产进程可期，A 股市场也将持续出现机会，但是疫情仍有反复出现的风险，可能带来经济修复预期差。同时，我们需要关注的风险点在

于，全球疫情的扩散带来的国际摩擦等黑天鹅事件。整体来说，我们对 2020 年下半年的市场持谨慎乐观态度。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支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。

### 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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,095,213.56	1,443,974.52
结算备付金		14,642.11	95,578.05
存出保证金		11,531.71	583,258.46
交易性金融资产	6.4.7.2	82,156,883.64	146,636,415.43
其中：股票投资		82,156,883.64	146,636,415.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		138,099.87	294,985.44
应收利息	6.4.7.5	1,364.11	1,371.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	100,729.50	-
资产总计		85,518,464.50	149,055,583.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,556,522.14	224,834.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,130.17	28,239.12
应付托管费		7,065.10	14,119.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,718.84	44,941.57
应交税费		-	7.78

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,535.36	100,000.00
负债合计		1,709,971.61	412,142.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	63,903,014.00	129,903,014.00
未分配利润	6.4.7.10	19,905,478.89	18,740,426.67
所有者权益合计		83,808,492.89	148,643,440.67
负债和所有者权益总计		85,518,464.50	149,055,583.08

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3115 元，基金份额总额 63,903,014.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 28 日(基金 合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		11,033,221.16	-1,210,811.85
1.利息收入		16,979.97	121,963.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,979.97	121,963.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,505,853.51	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,767,868.75	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	737,984.76	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-413,304.22	-1,332,775.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-76,308.10	-

减：二、费用		427,665.30	13,326.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,739.95	7,590.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	58,870.00	3,795.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	34,886.85	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	216,168.50	1,940.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,605,555.86	-1,224,138.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,605,555.86	-1,224,138.65

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	129,903,014.00	18,740,426.67	148,643,440.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,605,555.86	10,605,555.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-66,000,000.00	-9,440,503.64	-75,440,503.64
其中：1. 基金申购款	80,000,000.00	11,002,468.72	91,002,468.72
2. 基金赎回款	-146,000,000.00	-20,442,972.36	-166,442,972.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	63,903,014.00	19,905,478.89	83,808,492.89

项目	上年度可比期间		
	2019年6月28日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	693,903,014.00	-	693,903,014.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,224,138.65	-1,224,138.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	693,903,014.00	-1,224,138.65	692,678,875.35

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 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),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[2019]744 号《关于准予银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的注册,由银华基金管理股份有限公司于 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 6 月 21 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2019)验字第 60468687\_A07 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 6 月 28 日生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定。设立时募集扣除认购费后的实收基金现金部分为人民币 542,074,257.00 元,折合 542,074,257.00 份基金份额;截至

2019 年 6 月 27 日止募集的实收基金股票部分由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司划转至账号为 0899193339 的证券账户的有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 151,828,757.00 元，折合 151,828,757.00 份基金份额。上述两部分合计折算成基金份额为 693,903,014.00 份。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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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、衍生工具（股指期货、期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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，其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金的业绩比较基准为深证 100 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。”

#### 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	3,095,213.56
定期存款	-
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	-
合计：	3,095,213.56

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	68,663,791.55	82,156,883.64	13,493,092.09
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	68,663,791.55	82,156,883.64	13,493,092.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,329.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	29.12
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.20
合计	1,364.11

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	100,729.50

合计	100,729.50
----	------------

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	12,718.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,718.84

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	35,000.00
合计	119,535.36

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,903,014.00	129,903,014.00
本期申购	80,000,000.00	80,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-146,000,000.00	-146,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	63,903,014.00	63,903,014.00

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。

**6.4.7.10 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	16,747,794.28	1,992,632.39	18,740,426.67
本期利润	11,018,860.08	-413,304.22	10,605,555.86
本期基金份额交易产生的变动数	-11,994,634.59	2,554,130.95	-9,440,503.64
其中：基金申购款	13,476,061.88	-2,473,593.16	11,002,468.72
基金赎回款	-25,470,696.47	5,027,724.11	-20,442,972.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,772,019.77	4,133,459.12	19,905,478.89

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	14,612.21
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	923.00
其他	1,444.76
合计	16,979.97

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	991,080.11
股票投资收益——赎回差价收入	9,776,788.64
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	10,767,868.75

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,183,858.42
减：卖出股票成本总额	11,192,778.31
买卖股票差价收入	991,080.11

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	166,442,972.36
减：现金支付赎回款总额	-2,137,776.64
减：赎回股票成本总额	158,803,960.36
赎回差价收入	9,776,788.64

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	737,984.76
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	737,984.76

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-413,304.22

——股票投资	-413,304.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-413,304.22

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-76,308.10
合计	-76,308.10

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	34,886.85
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	34,886.85

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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	-
登记结算费	49,270.50
指数使用费	82,362.64
合计	216,168.50

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

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	基金管理人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年6月28日(基金合同生效日)至 2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国泰君安	27,685,812.70	100.00%	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
国泰君安	20,246.55	100.00%	12,718.84	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年6月28日(基金合同生效日)至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年6月28日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	117,739.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,206.63	44.76

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 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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 6 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,870.00	3,795.35

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

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

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

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

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
国泰君安股份 有限公司	1,277.00	0.00%	1,277.00	0.00%

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年6月28日(基金合同生效日)至 2019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
国泰君安	3,095,213.56	14,612.21	542,058,339.03	121,963.15

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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管理人股东发行的股票：国信证券（代码 002736）32,400 股，期末公允价值为人民币 366,120.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.44%；投资于基金管理人股东发行的股票：长城证券（代码 002939）14,300 股，期末公允价值为人民币 176,176.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.21%。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.12 期末（2020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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

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；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3

中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和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 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,095,213.56	-	-	-	-	-	3,095,213.56
结算备付金	14,642.11	-	-	-	-	-	14,642.11
存出保证金	11,531.71	-	-	-	-	-	11,531.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	82,156,883.64	82,156,883.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	138,099.87	138,099.87
应收利息	-	-	-	-	-	1,364.11	1,364.11
其他资产	-	-	-	-	-	100,729.50	100,729.50
资产总计	3,121,387.38	-	-	-	-	82,397,077.12	85,518,464.50
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,556,522.14	1,556,522.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,130.17	14,130.17
应付托管费	-	-	-	-	-	7,065.10	7,065.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,718.84	12,718.84
其他负债	-	-	-	-	-	119,535.36	119,535.36

负债总计	-	-	-	-	-	1,709,971.61	1,709,971.61
利率敏感度缺口	3,121,387.38	-	-	-	-	80,687,105.51	83,808,492.89
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,443,974.52	-	-	-	-	-	1,443,974.52
结算备付金	95,578.05	-	-	-	-	-	95,578.05
存出保证金	583,258.46	-	-	-	-	-	583,258.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	146,636,415.43	146,636,415.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-	294,985.44	294,985.44
应收利息	-	-	-	-	-	1,371.18	1,371.18
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,122,811.03	-	-	-	-	146,932,772.05	149,055,583.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,239.12	28,239.12
应付托管费	-	-	-	-	-	14,119.54	14,119.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	44,941.57	44,941.57
应交税费	-	-	-	-	-	7.78	7.78
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	224,834.40	224,834.40
负债总计	-	-	-	-	-	412,142.41	412,142.41
利率敏感度缺口	2,122,811.03	-	-	-	-	146,520,629.64	148,643,440.67

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金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。

## 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	82,156,883.64	98.03	146,636,415.43	98.65
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	82,156,883.64	98.03	146,636,415.43	98.65

## 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了 基金和基准的相关性。		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	3,734,834.23	4,824,928.45
	业绩比较基准下降 5%	-3,734,834.23	-4,824,928.45

## 6.4.14 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	82,156,883.64	96.07
	其中：股票	82,156,883.64	96.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,109,855.67	3.64
8	其他各项资产	251,725.19	0.29
9	合计	85,518,464.50	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,743,652.00	4.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,685,187.32	65.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,472.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	755,558.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,658,898.07	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,361,601.00	6.40
J	金融业	7,322,075.35	8.74
K	房地产业	4,052,688.72	4.84
L	租赁和商务服务业	915,151.00	1.09
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	294,150.00	0.35
Q	卫生和社会工作	2,456,856.18	2.93
R	文化、体育和娱乐业	790,594.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	82,156,883.64	98.03

### 7.2.2 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股票投资。

### 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	26,825	4,590,294.00	5.48
2	000333	美的集团	74,045	4,427,150.55	5.28
3	000651	格力电器	72,600	4,106,982.00	4.90
4	002475	立讯精密	63,858	3,279,108.30	3.91
5	000002	万科 A	103,800	2,713,332.00	3.24
6	300750	宁德时代	12,300	2,144,628.00	2.56
7	002714	牧原股份	26,130	2,142,660.00	2.56
8	000725	京东方 A	405,300	1,892,751.00	2.26
9	300760	迈瑞医疗	6,150	1,880,055.00	2.24
10	300059	东方财富	90,900	1,836,180.00	2.19
11	000661	长春高新	4,100	1,784,730.00	2.13
12	000001	平安银行	131,000	1,676,800.00	2.00
13	002415	海康威视	52,800	1,602,480.00	1.91
14	300498	温氏股份	73,440	1,600,992.00	1.91
15	000063	中兴通讯	38,200	1,532,966.00	1.83
16	002352	顺丰控股	22,000	1,203,400.00	1.44
17	300142	沃森生物	21,800	1,141,448.00	1.36
18	000100	TCL 科技	180,300	1,117,860.00	1.33
19	300015	爱尔眼科	25,670	1,115,361.50	1.33
20	002142	宁波银行	40,205	1,056,185.35	1.26
21	000568	泸州老窖	11,400	1,038,768.00	1.24
22	002410	广联达	13,900	968,830.00	1.16
23	002241	歌尔股份	32,100	942,456.00	1.12
24	000876	新希望	31,000	923,800.00	1.10
25	000338	潍柴动力	66,863	917,360.36	1.09



26	002027	分众传媒	164,300	915,151.00	1.09
27	002230	科大讯飞	24,100	902,063.00	1.08
28	002304	洋河股份	8,400	883,176.00	1.05
29	002594	比亚迪	12,300	883,140.00	1.05
30	300014	亿纬锂能	18,200	870,870.00	1.04
31	300122	智飞生物	8,400	841,260.00	1.00
32	002555	三七互娱	17,500	819,000.00	0.98
33	300347	泰格医药	7,800	794,664.00	0.95
34	002007	华兰生物	15,710	787,228.10	0.94
35	001979	招商蛇口	46,688	767,550.72	0.92
36	300601	康泰生物	4,355	706,206.80	0.84
37	000538	云南白药	7,500	703,575.00	0.84
38	000166	申万宏源	136,500	689,325.00	0.82
39	000895	双汇发展	14,200	654,478.00	0.78
40	300136	信维通信	12,200	646,844.00	0.77
41	002271	东方雨虹	15,900	646,017.00	0.77
42	300124	汇川技术	16,700	634,433.00	0.76
43	000938	紫光股份	14,480	622,350.40	0.74
44	000776	广发证券	43,800	618,456.00	0.74
45	300003	乐普医疗	16,800	613,536.00	0.73
46	002129	中环股份	27,300	613,158.00	0.73
47	002050	三花智控	26,900	589,110.00	0.70
48	002624	完美世界	10,100	582,164.00	0.69
49	000977	浪潮信息	14,760	578,296.80	0.69
50	300413	芒果超媒	8,800	573,760.00	0.68
51	002044	美年健康	37,948	546,830.68	0.65
52	002371	北方华创	3,100	529,821.00	0.63
53	002001	新和成	17,200	500,520.00	0.60
54	002311	海大集团	10,390	494,460.10	0.59
55	300454	深信服	2,400	494,304.00	0.59
56	300433	蓝思科技	17,400	487,896.00	0.58
57	002236	大华股份	25,100	482,171.00	0.58
58	000157	中联重科	74,100	476,463.00	0.57
59	002008	大族激光	13,000	467,350.00	0.56
60	002602	世纪华通	30,300	463,893.00	0.55
61	002024	苏宁易购	52,400	459,548.00	0.55
62	300408	三环集团	15,900	440,430.00	0.53
63	002841	视源股份	4,400	437,888.00	0.52
64	000860	顺鑫农业	7,400	421,652.00	0.50

65	002405	四维图新	24,700	407,303.00	0.49
66	000783	长江证券	59,300	399,682.00	0.48
67	300033	同花顺	3,000	399,240.00	0.48
68	002120	韵达股份	16,150	394,867.50	0.47
69	002916	深南电路	2,320	388,646.40	0.46
70	000425	徐工机械	64,500	381,195.00	0.45
71	002202	金风科技	37,909	377,952.73	0.45
72	002736	国信证券	32,400	366,120.00	0.44
73	000768	中航飞机	20,130	357,106.20	0.43
74	002157	正邦科技	20,000	349,600.00	0.42
75	000069	华侨城 A	57,600	349,056.00	0.42
76	002179	中航光电	8,400	344,484.00	0.41
77	000625	长安汽车	31,100	342,100.00	0.41
78	002466	天齐锂业	14,000	321,300.00	0.38
79	002493	荣盛石化	24,742	304,326.60	0.36
80	000963	华东医药	11,700	296,010.00	0.35
81	002607	中公教育	10,600	294,150.00	0.35
82	002422	科伦药业	14,000	294,000.00	0.35
83	000786	北新建材	13,400	285,822.00	0.34
84	000596	古井贡酒	1,900	285,456.00	0.34
85	000617	中油资本	27,300	283,647.00	0.34
86	000703	恒逸石化	28,220	257,648.60	0.31
87	002252	上海莱士	30,400	257,184.00	0.31
88	002146	荣盛发展	27,500	222,750.00	0.27
89	002673	西部证券	26,900	219,504.00	0.26
90	002739	万达电影	14,200	216,834.00	0.26
91	000050	深天马 A	13,800	211,968.00	0.25
92	002938	鹏鼎控股	4,223	211,403.38	0.25
93	002153	石基信息	4,800	187,344.00	0.22
94	002939	长城证券	14,300	176,176.00	0.21
95	002032	苏泊尔	2,200	156,200.00	0.19
96	002558	巨人网络	7,900	137,460.00	0.16
97	000723	美锦能源	21,800	136,468.00	0.16
98	003816	中国广核	40,700	120,472.00	0.14
99	000708	中信特钢	5,100	87,159.00	0.10
100	001965	招商公路	9,009	60,630.57	0.07

## 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	000661	长春高新	2,143,617.00	1.44
2	300014	亿纬锂能	828,918.00	0.56
3	300454	深信服	812,611.00	0.55
4	002555	三七互娱	800,408.00	0.54
5	000002	万科 A	691,641.00	0.47
6	002624	完美世界	575,844.00	0.39
7	002714	牧原股份	557,470.00	0.38
8	002050	三花智控	553,650.00	0.37
9	002371	北方华创	530,441.00	0.36
10	002352	顺丰控股	429,221.00	0.29
11	300033	同花顺	403,756.28	0.27
12	000858	五粮液	359,318.00	0.24
13	002841	视源股份	325,255.00	0.22
14	000001	平安银行	318,569.00	0.21
15	000895	双汇发展	295,640.00	0.20
16	000617	中油资本	274,216.00	0.18
17	002032	苏泊尔	264,465.00	0.18
18	000938	紫光股份	224,419.00	0.15
19	000333	美的集团	222,057.00	0.15
20	300601	康泰生物	215,448.00	0.14

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	000895	双汇发展	729,207.10	0.49
2	000333	美的集团	526,844.88	0.35
3	002304	洋河股份	491,609.42	0.33
4	000858	五粮液	461,767.00	0.31
5	002916	深南电路	435,352.48	0.29

6	000651	格力电器	414,735.71	0.28
7	300750	宁德时代	344,210.86	0.23
8	000001	平安银行	307,558.00	0.21
9	000596	古井贡酒	300,483.00	0.20
10	000728	国元证券	296,467.00	0.20
11	002475	立讯精密	272,878.70	0.18
12	000063	中兴通讯	270,192.50	0.18
13	300122	智飞生物	251,047.20	0.17
14	300413	芒果超媒	233,624.71	0.16
15	002415	海康威视	230,025.57	0.15
16	000540	中天金融	223,674.95	0.15
17	300059	东方财富	216,681.80	0.15
18	300760	迈瑞医疗	216,290.00	0.15
19	000413	东旭光电	211,954.00	0.14
20	002466	天齐锂业	211,055.50	0.14

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	15,541,489.48
卖出股票收入（成交）总额	12,183,858.42

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

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	11,531.71
2	应收证券清算款	138,099.87
3	应收股利	-
4	应收利息	1,364.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	100,729.50
8	其他	-
9	合计	251,725.19

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 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
1,262	50,636.30	29,025,888.00	45.42%	34,877,126.00	54.58%

### 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	中华联合财产保险股份有限公司— 传统保险产品	21,168,000.00	33.13%
2	中信建投证券股份有限公司	3,558,303.00	5.57%
3	广发证券股份有限公司	2,275,223.00	3.56%
4	申万宏源证券有限公司	1,418,195.00	2.22%
5	何青梅	1,027,313.00	1.61%
6	谭淑珣	1,000,019.00	1.56%
7	朱晨	678,133.00	1.06%
8	华泰证券股份有限公司	593,229.00	0.93%
9	游权	550,000.00	0.86%
10	王琦	540,114.00	0.85%

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

截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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的情况

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6月28日）基金份额总额	693,903,014.00
本报告期期初基金份额总额	129,903,014.00
本报告期基金总申购份额	80,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	146,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	63,903,014.00

## § 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未发生重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 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

本基金本报告期末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

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	3	27,685,812.70	100.00%	20,246.55	100.00%	-

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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 1 月 18 日
2	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 18 日
3	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
4	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
5	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
6	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 19 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	四大证券报	2020 年 3 月 24 日
9	《银华基金管理股份有限公司关	三大证券报、中国证	2020 年 3 月 25 日

	于增加东吴证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	
10	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 27 日
11	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 2 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 27 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告》	上海证券报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 27 日
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 18 日
14	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 18 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 22 日
16	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
17	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 3 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 30 日
18	《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 3 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 30 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	2020/03/18-2020/06/30	21,168,000.00	0.00	0.00	21,168,000.00	33.13%

个 人	1	2020/01/01-2020/03/17	29,910,000.00	0.00	29,910,000.00	0	0.00%
产品特有风险							
<p>投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：</p> <p>1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；</p> <p>2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；</p> <p>3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2020 年 3 月 19 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

2、本基金管理人与 2020 年 3 月 27 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告》，自 2020 年 3 月 27 日起，本基金的指数许可使用费，由原来的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000），调整为：当本基金的季度日均基金资产净值（季度日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数）大于人民币 5000 万元时，许可使用费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无指数许可使用费的收取下限，指数许可使用费收取则按照基点费计费公式以基金当季存续天数计算。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华深证 100 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 《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华深证 100 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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2020 年 8 月 28 日