

# 银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	63
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	63
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	63

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华-道琼斯 88 精选证券投资基金
基金简称	银华-道琼斯 88 指数
基金主代码	180003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 8 月 11 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,531,700,116.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将运用增强型指数化投资方法，通过严格的投资流程和数量化风险管理，在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，以道琼斯中国 88 指数为基金投资组合跟踪的标的指数，股票指数化投资部分主要投资于标的指数的成份股票，增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票，在控制与标的指数偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益率。 本基金将不高于 95% 的资产投资于股票，且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	道琼斯中国 88 指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益与预期风险高于债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	李申
	联系电话	(010)58163000	021-60637102
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	021-60637111
传真		(010)58163027	021-60635778
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号	北京市西城区闹市口大街 1 号

	东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	院 1 号楼
邮政编码	100738	100033
法定代表人	王珠林	田国立

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	470,784,115.27	281,587,783.30	-125,649,596.03
本期利润	974,677,678.14	653,531,032.17	-498,024,355.53
加权平均基金份额本期利润	0.6837	0.3637	-0.2546
本期加权平均净值利润率	46.75%	30.74%	-22.85%
本期基金份额净值增长率	54.91%	36.42%	-21.25%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	834,040,576.75	544,718,772.92	-66,379,174.66
期末可供分配基金份额利润	0.5445	0.3170	-0.0346
期末基金资产净值	2,760,381,867.71	2,263,096,095.43	1,849,825,013.82
期末基金份额净值	1.8022	1.3170	0.9654
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	766.87%	459.60%	310.20%

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认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

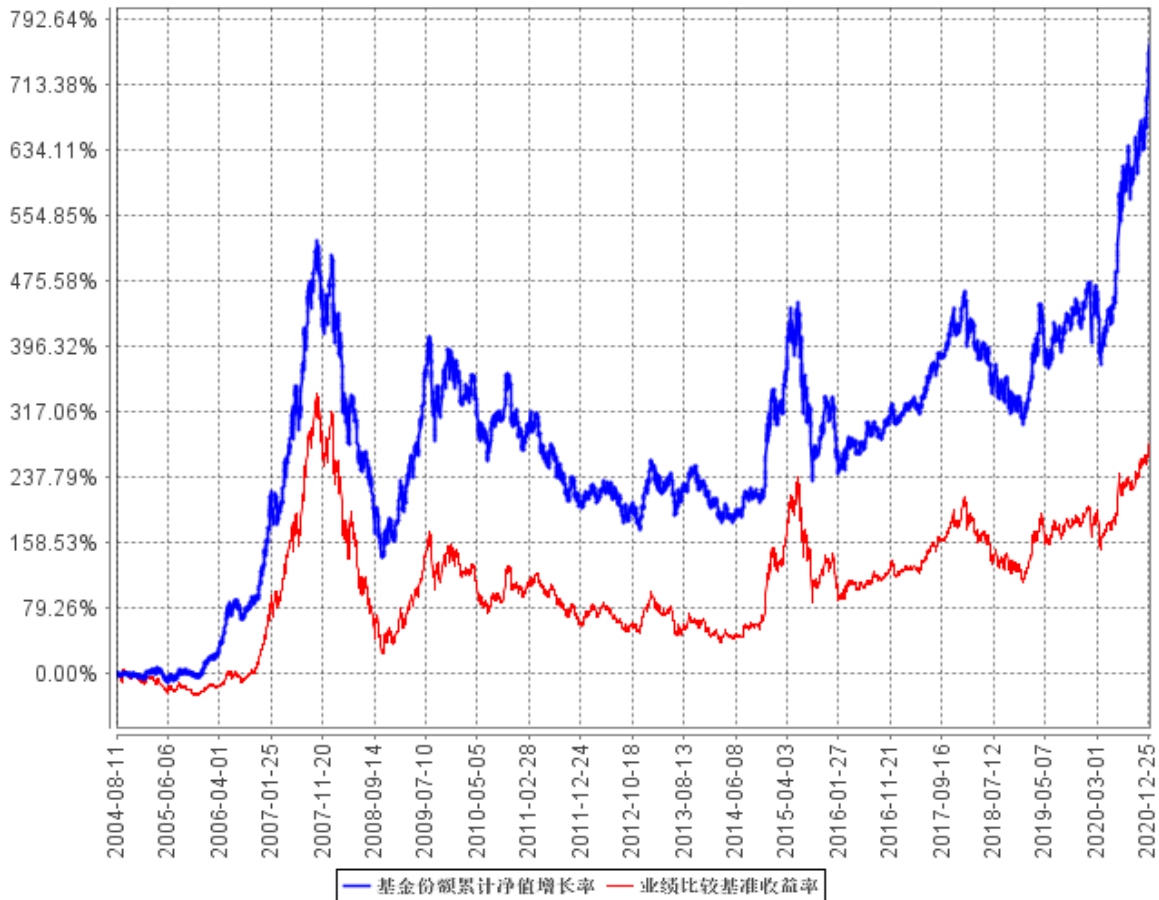
#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	22.37%	1.22%	17.27%	1.02%	5.10%	0.20%
过去六个月	44.61%	1.43%	29.22%	1.35%	15.39%	0.08%
过去一年	54.91%	1.55%	28.55%	1.42%	26.36%	0.13%
过去三年	66.42%	1.34%	35.24%	1.36%	31.18%	-0.02%
过去五年	105.88%	1.19%	60.64%	1.24%	45.24%	-0.05%
自基金合同生效起至今	766.87%	1.48%	282.11%	1.69%	484.76%	-0.21%

### 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

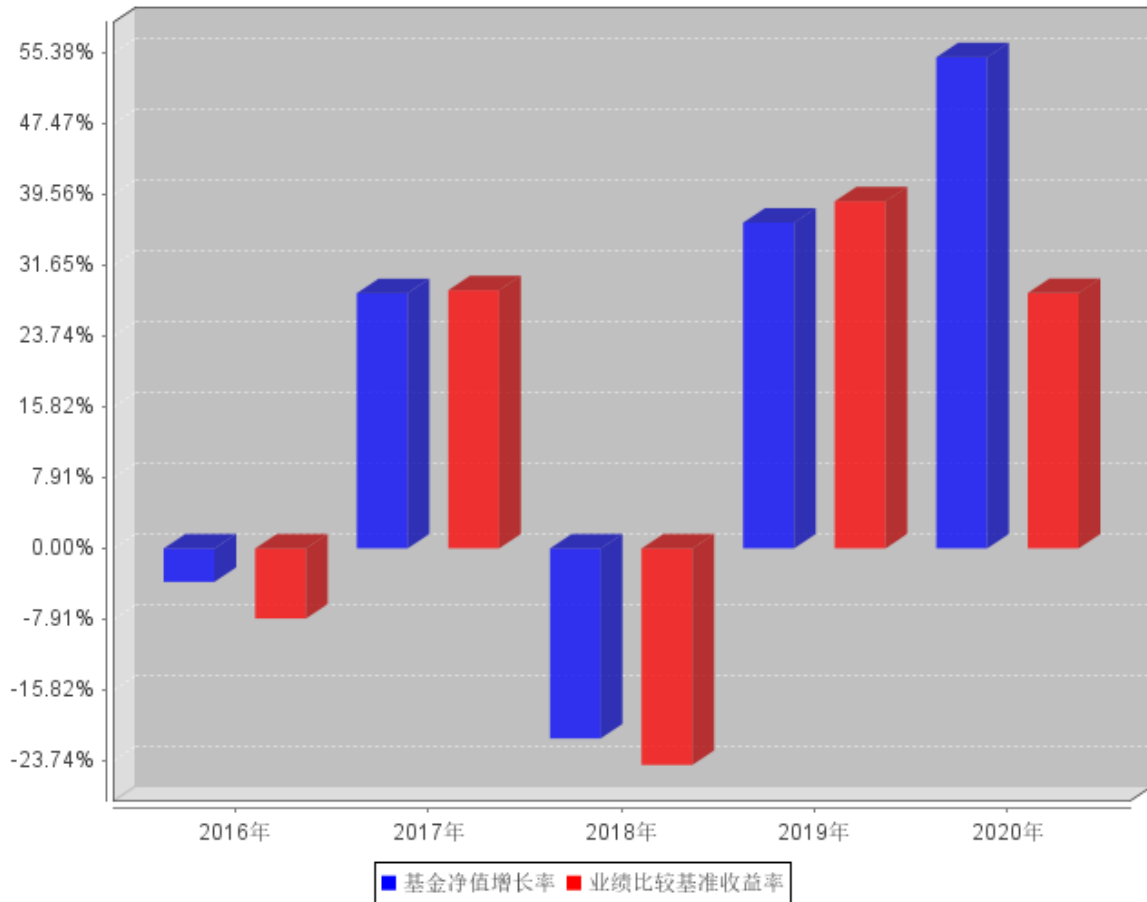


注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	2.235	221,438,540.04	109,970,114.36	331,408,654.40	
2019	-	-	-	-	
2018	0.100	12,230,255.81	8,507,328.99	20,737,584.80	
合计	2.335	233,668,795.85	118,477,443.35	352,146,239.20	

注：本基金于 2019 年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 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 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 133 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 指数证券投资基金 (LOF)、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 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、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金

(FOF)、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、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、银华长江经济带主题债券型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周晶女士	本基金的基金经理	2018 年 11 月 12 日	-	14 年	硕士学位。曾就职于银华基金管理有限公司、中欧基金管理有限公司。2018 年 8 月再次加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 12 日起担任银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 27 日起兼任银华沪港深增长股票型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-道琼斯 88 精选证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,制定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的日常监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步修订了公平交易的范围,修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不掺杂任何的人为判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2、一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易,并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应,且各投资组合获得公平的交易机会;3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组

合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

##### 4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，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。

在投资决策环节，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。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

##### 4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

银华道琼斯 88 精选基金是银华基金公司最早募集的基金产品之一，在这只成立于 2004 年的产品中，绝大部分投资人的持有期限超过十年。成为这只产品的基金经理之后，我感受到的压力较管理其他产品更为沉重，基金行业多年来一直倡导长期投资的理念，道琼斯 88 精选基金的持有人无疑是这方面的表率，我们必须加倍努力，不负重托。值得欣慰的是，本基金的净值在 2020 年度创出了历史新高，并进行了近十年以来最大比例的分红，以感谢持有人长期的坚守。

我看到许多持有人在基金吧里讨论道琼斯 88 基金究竟是投资美股还是 A 股？究竟是指数基金还是主动管理基金？在今天的说明段中，我想向各位持有人介绍一下我管理本基金两年之后对这支产品的理解和未来的投资策略。

道琼斯 88 精选基金是一只投资于 A 股市场，以大盘龙头股为主要风格的主动管理基金。这支产品在一个由 88 只 A 股上市公司构成的股票池中选择其 60% 的投资标的，而这 88 家公司的名单是由标普道琼斯指数公司为银华基金定制的，每季度更新一次，可以简单理解为海外指数公司眼中，最能代表中国经济的各行业的龙头构成的一个股票池。本基金在这 88 个标的中进一步精选标的来构建组合。我们在过去两年的管理中，也一直以深度研究为基础，选出最能代表中国经济中长期增长动力的优质龙头来构建组合，这一策略在过去两年使得本基金创造了超越基准指数的表现。

### 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 1.8022 元；本报告期基金份额净值增长率为 54.91%，业绩比较基准收益率为 28.55%。

## 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 2021 年，我们相信继续坚持优选龙头的策略能够在长期继续为持有人获取超额收益。从经济基本面角度看，中国的大部分行业都走到了现有格局难以被颠覆的发展阶段，龙头企业的竞争优势会越来越突出；从资本市场的交易结构看，注册制、退市制度等资本市场改革措施不断推进，海外资金不断流入、机构投资者占比不断提高的大背景下，A 股市场向成熟资本市场估值体系逐渐靠拢已经是非常明显的趋势，在海外成熟市场，具有竞争优势的龙头是长期享受估值溢价的。因此，当下核心资产享受溢价的风格会在较长时期内持续下去，而道琼斯 88 精选基金的组合正是在核心资产中进一步精选投资标的，基于我们的组合构建理念是做长期正确的事，我们相信这支 16 岁的产品也与花季少年一样充满生命力，具备继续为长期持有人创造收益的潜力。

如何优选龙头呢？我们的投资理念是以深度研究为基础，找到真正能够持续创造超越社会平

均水平股东回报的公司，也即各行业具备长期竞争优势的企业，在一个估值偏低的位置上买入并持有，陪伴公司有小长大、由优秀变为卓越。

本基金的策略，是淡化行业轮动与择时，专注寻找好的商业模式下具有长期持续竞争壁垒的好公司，我们从商业模式和市场空间两个维度出发，去寻找具有巨大空间的行业中，可成功的商业模式。同时，我们十分看重企业的竞争壁垒，我们买入并长期持有各行业可长期维持自身竞争壁垒的龙头企业，这些企业具有可重复成功的商业模式，也能抵御竞争对手的模仿或赶超，可在将长时间内创造超越社会平均回报。

优秀的公司通常在估值上会有溢价，很少给到让人舒服的买入价格。买点通常都出现在企业遭遇到与自身经营关系不大的外部宏观因素冲击的时候，因此，我们通过对优秀企业的深刻理解来进行择时，优秀企业们正是在一轮又一轮的经济低迷期中，经受住外部恶劣环境的考验，以螺旋上升的形式成长起来的。正是这些宏观经济风险的暴露，给了我们以极低价格买入有成长、有价值的好企业的机会。比如 2018 年的宏观去杠杆，又比如 2020 年初爆发的新冠疫情。

从中长期看，我们梳理出来的我们重点关注的三条主线是：1、中国广大的内需市场；2、中国制造业不断升级过程中国际竞争力的提升；3、中华文化拼搏奋斗的内核孕育出的卓越的企业家精神。沿着这三个方向做研究，我们发现即使经历了过去两年的大幅上涨，仍有一批优秀的企业具有很好的成长性，也将在中长期内持续吸引全球投资者的关注。这部分公司即使短期估值偏高，但其长期的成长性和全球稀缺性有望消化其估值压力，长期来看仍将为股东创造较好的超额收益。

回到短期来看 2021 年，疫情冲击过后的经济复苏将带动企业盈利恢复，但市场流动性从非常时期的极度宽松逐步常态化，又会阶段性对市场估值水平产生压制。因此我们认为 2021 年市场更可能存在的是结构性的投资机会。基于我们长期坚持的，在优秀企业遭受外部冲击时进行买入的择时方法论，我们看好因高值耗材集采带来系统性下跌过后的医药行业，以及华为事件压制下的硬件科技板块的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了监察稽核机制，根据不同基金的特点与公司业务发展情况，及时界定新的合规风险点，并在年初制定监察稽核工作计划及重点，以专项检查或抽查的形式对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务环节进行检查。

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与



销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

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

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

##### **4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金管理人于 2020 年 1 月 20 日发布公告，向截至 2020 年 1 月 21 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人发放红利，每 10 份基金份额派发红利 0.100 元，实际分配金额为人民币 16,706,703.77 元。

本基金管理人于 2020 年 12 月 25 日发布公告，向截至 2020 年 12 月 28 日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人发放红利，每 10 份基金份额派发红利 2.135 元，实际分配金额为人民币 314,701,950.63 元。

#### **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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金对基金份额持有人进行了利润分配，实际分配金额为人民币 331,408,654.40 元。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61329181_A02 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华-道琼斯 88 精选证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华-道琼斯 88 精选证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银华-道琼斯 88 精选证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估银华-道琼斯 88 精选证券投资</p>

	<p>基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华-道琼斯 88 精选证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华-道琼斯 88 精选证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺 耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	277,993,198.04	200,666,881.55
结算备付金		4,916,375.40	2,677,754.31
存出保证金		483,348.14	584,109.28
交易性金融资产	7.4.7.2	2,486,608,473.72	2,056,219,429.76
其中：股票投资		2,486,608,473.72	2,056,219,429.76
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	26,017,218.17
应收利息	7.4.7.5	42,040.03	47,452.39
应收股利		-	-
应收申购款		1,333,576.63	394,688.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	233.25	233.25
资产总计		2,771,377,245.21	2,286,607,766.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,412,491.46
应付赎回款		5,820,681.59	11,336,127.07
应付管理人报酬		2,752,482.88	2,176,678.37
应付托管费		573,433.93	453,474.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,376,191.62	1,659,926.91
应交税费		0.16	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	472,587.32	472,973.02
负债合计		10,995,377.50	23,511,671.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,531,700,116.22	1,718,377,322.51
未分配利润	7.4.7.10	1,228,681,751.49	544,718,772.92
所有者权益合计		2,760,381,867.71	2,263,096,095.43
负债和所有者权益总计		2,771,377,245.21	2,286,607,766.90

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8022 元，基金份额总额 1,531,700,116.22 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,017,083,937.95	697,293,669.66
1.利息收入		1,260,345.14	2,541,165.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,260,293.20	1,656,969.55
债券利息收入		51.94	844,743.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	39,452.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		511,617,345.25	322,709,229.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	496,779,218.35	291,548,914.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	168,804.58	-55,622.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	14,669,322.32	31,215,937.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	503,893,562.87	371,943,248.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	312,684.69	100,026.53
<b>减：二、费用</b>		42,406,259.81	43,762,637.49

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	24,949,852.61	25,481,899.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,197,886.05	5,308,728.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	11,982,767.62	12,704,233.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.18	-
7. 其他费用	7.4.7.20	275,753.35	267,775.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		974,677,678.14	653,531,032.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		974,677,678.14	653,531,032.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	1,718,377,322.51	544,718,772.92	2,263,096,095.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	974,677,678.14	974,677,678.14
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）	-186,677,206.29	40,693,954.83	-145,983,251.46
其中：1. 基金申购款	525,622,211.19	366,235,926.47	891,858,137.66
2. 基金赎回款	-712,299,417.48	-325,541,971.64	-1,037,841,389.12
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）	-	-331,408,654.40	-331,408,654.40
五、期末所有者权益（基金净值）	1,531,700,116.22	1,228,681,751.49	2,760,381,867.71
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	1,916,204,188.48	-66,379,174.66	1,849,825,013.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	653,531,032.17	653,531,032.17
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)	-197,826,865.97	-42,433,084.59	-240,259,950.56
其中：1. 基金申购款	151,717,122.51	35,212,584.14	186,929,706.65
2. 基金赎回款	-349,543,988.48	-77,645,668.73	-427,189,657.21
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)	1,718,377,322.51	544,718,772.92	2,263,096,095.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新
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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华-道琼斯 88 精选证券投资基金(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”)证监基金字[2004]82 号文《关于同意银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的批复》的核准,由银华基金管理股份有限公司于 2004 年 7 月 5 日至 2004 年 8 月 5 日向社会公开发行募集,基金合同于 2004 年 8 月 11 日正式生效,首次设立募集规模为 1,085,604,444.01 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为向香港投资人提供更为丰富的投资品种,本基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定于 2018 年 9 月 7 日起对本基金增设 H 类基金份额,并对本基金的基金合同及托管协议作相应修改。本基金在中国内地销售的基金份额类别称为 A 类基金份额;在中国香

港特别行政区销售的基金份额类别称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额分别设置基金代码，并分别计算基金份额净值。本基金新增加的 H 类基金份额类别，仅在中国香港地区销售。截至本报告期末，H 类基金份额尚未实际销售。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括道琼斯中国 88 指数的成份 A 股及其备选成份股、新股（首发或增发）、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债等债券资产）以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，各类资产投资比例符合《证券投资基金法》的规定。在资产类别配置上，本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为道琼斯中国 88 指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司

代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金 A 类基金份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利自动转为基金份额进行再投资；选择采取红利再投资形式的，分红现金按红利发放日的基金单位净值转成相应的基金单位；本基金分红的默认方式为现金方式；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(4) 如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

(5) 基金收益分配后各类基金份额每份基金份额的净值不能低于该类基金份额的面值；

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；

(7) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满三个月，收益可不分配；

(8) 红利分配时所发生的银行转账或其他注册登记费用由投资者自行承担；

(9)法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	277,993,198.04	200,666,881.55
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：	277,993,198.04	200,666,881.55

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,568,472,295.83	2,486,608,473.72	918,136,177.89
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	1,568,472,295.83	2,486,608,473.72	918,136,177.89
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,641,976,814.74	2,056,219,429.76	414,242,615.02
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	1,641,976,814.74	2,056,219,429.76	414,242,615.02

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	39,363.14	44,437.69
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	2,433.64	1,325.39
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	4.00	1,400.12
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	239.25	289.19
合计	42,040.03	47,452.39

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
其他应收款	233.25	233.25
待摊费用	-	-
合计	233.25	233.25

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,376,191.62	1,659,926.91
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,376,191.62	1,659,926.91

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,586.17	2,971.87
应付证券出借违约金	-	-
其他	260,001.15	260,001.15
预提费用	210,000.00	210,000.00
合计	472,587.32	472,973.02

## 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,718,377,322.51	1,718,377,322.51
本期申购	525,622,211.19	525,622,211.19
本期赎回(以“-”号填列)	-712,299,417.48	-712,299,417.48
- 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	1,531,700,116.22	1,531,700,116.22

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。

#### 7.4.7.10 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	746,604,197.20	-201,885,424.28	544,718,772.92
本期利润	470,784,115.27	503,893,562.87	974,677,678.14
本期基金份额交易产生的变动数	-51,939,081.32	92,633,036.15	40,693,954.83
其中：基金申购款	335,831,496.83	30,404,429.64	366,235,926.47
基金赎回款	-387,770,578.15	62,228,606.51	-325,541,971.64
本期已分配利润	-331,408,654.40	-	-331,408,654.40
本期末	834,040,576.75	394,641,174.74	1,228,681,751.49

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	1,189,330.75	1,584,075.03
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	49,687.17	59,977.28
其他	21,275.28	12,917.24
合计	1,260,293.20	1,656,969.55

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	496,779,218.35	291,548,914.35
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	496,779,218.35	291,548,914.35
----	----------------	----------------

#### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	4,241,443,323.62	4,398,248,553.26
减：卖出股票成本总额	3,744,664,105.27	4,106,699,638.91
买卖股票差价收入	496,779,218.35	291,548,914.35

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	168,804.58	-55,622.47
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	168,804.58	-55,622.47

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	956,058.07	81,232,029.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	787,200.00	79,219,437.47

减：应收利息总额	53.49	2,068,214.29
买卖债券差价收入	168,804.58	-55,622.47

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,669,322.32	31,215,937.27
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	14,669,322.32	31,215,937.27

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	503,893,562.87	371,943,248.87
——股票投资	503,893,562.87	372,666,058.20
——债券投资	-	-722,809.33
——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	503,893,562.87	371,943,248.87

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	308,575.50	96,490.87
其他	440.32	-
转换费	3,668.87	3,535.66
合计	312,684.69	100,026.53

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	11,982,767.62	12,704,233.77
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,982,767.62	12,704,233.77

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	28,553.35	20,575.57
账户服务费	37,200.00	37,200.00
合计	275,753.35	267,775.57



## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司（注 2）	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理（北京）有限公司（注 1）	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

注 1：根据 2020 年 10 月 24 日《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称、住所及法定代表人变更的公告》，子公司银华资本管理（珠海横琴）有限公司更名为银华长安资本管理（北京）有限公司。

注 2：根据 2020 年 12 月 2 日《银华基金管理股份有限公司关于股东名称变更的公告》，股东山西海鑫实业股份有限公司更名为山西海鑫实业有限公司。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
第一创业	896,714,904.77	11.40%	1,081,680,479.15	12.62%
东北证券	603,303,013.82	7.67%	270,953,717.83	3.16%
西南证券	-	-	358,959,264.68	4.19%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
第一创业	835,110.82	12.12%	-	-
东北证券	561,854.66	8.15%	184,405.71	13.40%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
西南证券	325,346.28	4.33%	-	-
第一创业	1,007,362.44	13.40%	308,166.57	18.57%
东北证券	217,929.26	2.90%	125,990.54	7.59%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,949,852.61	25,481,899.19
其中：支付销售机构的客户维护费	3,474,207.08	3,676,924.22

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 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,197,886.05	5,308,728.96

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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

注：无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

注：无。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	277,993,198.04	1,189,330.75	200,666,881.55	1,584,075.03

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020年 12月28 日	-	2020 年12 月28 日	2.135	211,359,067.34	103,342,883.29	314,701,950.63	
2	2020年 1月21 日	-	2020 年1月 21日	0.100	10,079,472.70	6,627,231.07	16,706,703.77	
合计	-	-	-	2.235	221,438,540.04	109,970,114.36	331,408,654.40	

**7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
601995	中金	2020年	2021	新发	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-

	公司	10月22日	年5月6日	流通受限						
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新发流通受限	25.70	88.29	9,842	252,939.40	868,950.18	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新发流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
688519	南亚新材	2020年8月10日	2021年2月18日	新发流通受限	32.60	30.51	9,329	304,125.40	284,627.79	-
688313	仕佳光子	2020年8月4日	2021年2月18日	新发流通受限	10.82	22.92	7,151	77,373.82	163,900.92	-
688069	德林海	2020年7月15日	2021年1月22日	新发流通受限	67.20	62.45	2,253	151,401.60	140,699.85	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新发流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新发流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300919	中伟	2020年	2021	新发	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

	股份	12月15日	年6月23日	流通受限						
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新发流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新发流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新发流通受限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新发流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新发流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新发流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新发流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新发流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫	2020年	2021	新发	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-

	乳品	10月9日	年4月16日	流通受限							
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新发流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-	
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新发流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-	
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新发流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-	
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新发流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-	
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新发流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-	
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新发流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-	
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	新发流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-	
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新发流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-	
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新发流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-	
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	新发流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-	
300907	康平	2020年	2021	新发	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-	

	科技	11月11日	年5月18日	流通受限							
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新发流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-	
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新发流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新发流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-	
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新发流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-	
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新发流通受限	138.02	126.67	76	10,489.52	9,626.92	-	
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新发流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-	
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	新发流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-	
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新发流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-	
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新发流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-	
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-	
300886	华业	2020年	2021	新发	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-	



	香料	9月8日	年3月16日	流通受限						
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	277,993,198.04	-	-	-	-	-	277,993,198.04
结算备付金	4,916,375.40	-	-	-	-	-	4,916,375.40
存出保证金	483,348.14	-	-	-	-	-	483,348.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,486,608,473.72	-2,486,608,473.72
应收利息	-	-	-	-	-	42,040.03	42,040.03
应收申购款	2,759.41	-	-	-	-	1,330,817.22	1,333,576.63
其他资产	-	-	-	-	-	233.25	233.25
资产总计	283,395,680.99	-	-	-	-	-2,487,981,564.22	2,771,377,245.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,820,681.59	5,820,681.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,752,482.88	2,752,482.88
应付托管费	-	-	-	-	-	573,433.93	573,433.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,376,191.62	1,376,191.62
应交税费	-	-	-	-	-	0.16	0.16
其他负债	-	-	-	-	-	472,587.32	472,587.32
负债总计	-	-	-	-	-	10,995,377.50	10,995,377.50
利率敏感度缺口	283,395,680.99	-	-	-	-	-2,476,986,186.72	2,760,381,867.71
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	200,666,881.55	-	-	-	-	-	200,666,881.55
结算备付金	2,677,754.31	-	-	-	-	-	2,677,754.31
存出保证金	584,109.28	-	-	-	-	-	584,109.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,056,219,429.76	-2,056,219,429.76
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,017,218.17	26,017,218.17
应收利息	-	-	-	-	-	47,452.39	47,452.39
应收申购款	1,988.09	-	-	-	-	392,700.10	394,688.19

其他资产	-	-	-	-	233.25	233.25
资产总计	203,930,733.23	-	-	-	-2,082,677,033.67	2,286,607,766.90
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	7,412,491.46	7,412,491.46
应付赎回款	-	-	-	-	11,336,127.07	11,336,127.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,176,678.37	2,176,678.37
应付托管费	-	-	-	-	453,474.64	453,474.64
应付交易费用	-	-	-	-	1,659,926.91	1,659,926.91
其他负债	-	-	-	-	472,973.02	472,973.02
负债总计	-	-	-	-	23,511,671.47	23,511,671.47
利率敏感度缺口	203,930,733.23	-	-	-	-2,059,165,362.20	2,263,096,095.43

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	2,486,608,473.72	90.08	2,056,219,429.76	90.86
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	2,486,608,473.72	90.08	2,056,219,429.76	90.86

#### 7.4.13.4.2.2 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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	133,985,732.03	106,025,719.41
	业绩比较基准下降 5%	-133,985,732.03	-106,025,719.41

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,482,311,823.20 元，属于第二层次的余额为人民币 206,601.13 元，属于第三层次的余额为人民币 4,090,049.39 元（上年度末：第一层次人民币 2,048,975,048.35 元，第二层次人民币 290,022.75 元，第三层次人民币 6,954,358.66 元）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量

的金融工具转出第三层次公允价值的金额为人民币 97,960.80 元（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,486,608,473.72	89.72
	其中：股票	2,486,608,473.72	89.72
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	282,909,573.44	10.21
8	其他各项资产	1,859,198.05	0.07
9	合计	2,771,377,245.21	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,747.00	0.00
C	制造业	1,218,195,032.66	44.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,916.00	0.00
E	建筑业	497.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,389.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,753,581.90	2.64
J	金融业	49,743.92	0.00
K	房地产业	2,870.00	0.00
L	租赁和商务服务业	192,375,139.95	6.97
M	科学研究和技术服务业	150,417,574.40	5.45

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	7,489.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,633,821,980.83	59.19

### 8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	663.14	0.00
C	制造业	785,514,277.32	28.46
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	20,934.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,321,342.31	2.37
J	金融业	1,718,560.41	0.06
K	房地产业	13,335.04	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	155,780.95	0.01
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	9,626.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	852,786,492.89	30.89

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。



### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	669,013	195,251,444.05	7.07
2	601888	中国中免	681,091	192,374,152.95	6.97
3	600519	贵州茅台	89,863	179,546,274.00	6.50
4	603259	药明康德	1,116,520	150,417,574.40	5.45
5	002049	紫光国微	824,747	110,359,396.07	4.00
6	000661	长春高新	234,601	105,314,734.91	3.82
7	002475	立讯精密	1,787,180	100,296,541.60	3.63
8	000333	美的集团	956,663	94,173,905.72	3.41
9	300760	迈瑞医疗	171,345	72,992,970.00	2.64
10	600570	恒生电子	693,471	72,745,107.90	2.64
11	601012	隆基股份	691,447	63,751,413.40	2.31
12	600309	万华化学	659,319	60,024,401.76	2.17
13	600276	恒瑞医药	528,835	58,943,949.10	2.14
14	002304	洋河股份	216,820	51,167,351.80	1.85
15	002460	赣锋锂业	350,190	35,439,228.00	1.28
16	000568	泸州老窖	135,163	30,568,464.08	1.11
17	600887	伊利股份	686,349	30,453,305.13	1.10
18	300122	智飞生物	201,444	29,795,582.04	1.08
19	300750	宁德时代	100	35,111.00	0.00
20	002594	比亚迪	100	19,430.00	0.00
21	603799	华友钴业	130	10,309.00	0.00
22	600745	闻泰科技	100	9,900.00	0.00
23	002352	顺丰控股	100	8,823.00	0.00
24	601318	中国平安	100	8,698.00	0.00
25	600009	上海机场	100	7,566.00	0.00
26	300015	爱尔眼科	100	7,489.00	0.00
27	000651	格力电器	100	6,194.00	0.00
28	601336	新华保险	100	5,797.00	0.00
29	600585	海螺水泥	100	5,162.00	0.00
30	002415	海康威视	100	4,851.00	0.00
31	600036	招商银行	100	4,395.00	0.00
32	600588	用友网络	100	4,387.00	0.00
33	002007	华兰生物	100	4,224.00	0.00

34	002230	科大讯飞	100	4,087.00	0.00
35	601601	中国太保	100	3,840.00	0.00
36	601628	中国人寿	100	3,839.00	0.00
37	002142	宁波银行	100	3,534.00	0.00
38	600031	三一重工	100	3,498.00	0.00
39	000063	中兴通讯	100	3,365.00	0.00
40	300059	东方财富	100	3,100.00	0.00
41	600999	招商证券	130	3,034.20	0.00
42	600030	中信证券	100	2,940.00	0.00
43	000002	万科 A	100	2,870.00	0.00
44	600703	三安光电	100	2,701.00	0.00
45	000977	浪潮信息	100	2,688.00	0.00
46	600104	上汽集团	100	2,444.00	0.00
47	601166	兴业银行	100	2,087.00	0.00
48	002236	大华股份	100	1,989.00	0.00
49	000001	平安银行	100	1,934.00	0.00
50	600900	长江电力	100	1,916.00	0.00
51	601688	华泰证券	100	1,801.00	0.00
52	000776	广发证券	100	1,628.00	0.00
53	000338	潍柴动力	100	1,579.00	0.00
54	002456	欧菲光	100	1,318.00	0.00
55	600837	海通证券	100	1,286.00	0.00
56	002027	分众传媒	100	987.00	0.00
57	601899	紫金矿业	100	929.00	0.00
58	601328	交通银行	191	855.68	0.00
59	000100	TCL 科技	100	708.00	0.00
60	000725	京东方 A	100	600.00	0.00
61	601398	工商银行	106	528.94	0.00
62	601668	中国建筑	100	497.00	0.00
63	601857	中国石油	100	415.00	0.00
64	600028	中国石化	100	403.00	0.00
65	601818	光大银行	100	399.00	0.00
66	601288	农业银行	15	47.10	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	603486	科沃斯	1,154,036	102,120,645.64	3.70
2	600346	恒力石化	3,159,591	88,373,760.27	3.20
3	300558	贝达药业	696,421	74,774,722.77	2.71
4	603613	国联股份	504,211	64,579,344.88	2.34
5	600966	博汇纸业	4,248,383	63,853,196.49	2.31
6	002960	青鸟消防	1,502,500	56,208,525.00	2.04
7	688122	西部超导	688,154	54,715,124.54	1.98
8	601799	星宇股份	268,431	53,820,415.50	1.95
9	603517	绝味食品	648,828	50,310,123.12	1.82
10	600132	重庆啤酒	370,169	44,046,409.31	1.60
11	000799	酒鬼酒	255,400	39,970,100.00	1.45
12	600882	妙可蓝多	665,300	37,988,630.00	1.38
13	002389	航天彩虹	1,024,200	34,054,650.00	1.23
14	002242	九阳股份	904,140	28,968,645.60	1.05
15	002409	雅克科技	413,780	24,864,040.20	0.90
16	300896	爱美客	22,630	14,798,667.42	0.54
17	300218	安利股份	1,237,600	12,648,272.00	0.46
18	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.06
19	688608	恒玄科技	4,179	1,383,249.00	0.05
20	300999	金龙鱼	9,842	868,950.18	0.03
21	688777	中控技术	5,794	580,558.80	0.02
22	688519	南亚新材	9,329	284,627.79	0.01
23	300909	汇创达	3,858	199,193.82	0.01
24	688021	奥福环保	2,940	180,310.20	0.01
25	688313	仕佳光子	7,151	163,900.92	0.01
26	688069	德林海	2,253	140,699.85	0.01
27	300911	亿田智能	3,083	126,030.04	0.00
28	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
29	688004	博汇科技	2,500	116,725.00	0.00
30	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
31	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
32	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
33	300919	中伟股份	622	38,501.74	0.00
34	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
35	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
36	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
37	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
38	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
39	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00

40	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
41	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
42	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
43	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
44	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
45	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
46	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
47	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
48	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
49	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
50	605177	东亚药业	439	15,584.50	0.00
51	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
52	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
53	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
54	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
55	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
56	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
57	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
58	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
59	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
60	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
61	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
62	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
63	300860	锋尚文化	76	9,626.92	0.00
64	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
65	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
66	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
67	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
68	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
69	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
70	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
71	600019	宝钢股份	528	3,141.60	0.00
72	600516	方大炭素	363	2,566.41	0.00
73	600015	华夏银行	376	2,350.00	0.00
74	600340	华夏幸福	130	1,680.90	0.00
75	600383	金地集团	100	1,350.00	0.00
76	001979	招商蛇口	100	1,329.00	0.00
77	600271	航天信息	100	1,260.00	0.00
78	601229	上海银行	130	1,019.20	0.00

79	600115	东方航空	200	936.00	0.00
80	601009	南京银行	100	808.00	0.00
81	601225	陕西煤业	71	663.14	0.00
82	601989	中国重工	100	419.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	140,965,570.26	6.23
2	603259	药明康德	134,463,253.22	5.94
3	600104	上汽集团	125,358,129.54	5.54
4	600887	伊利股份	120,563,074.70	5.33
5	601888	中国中免	115,407,324.89	5.10
6	601628	中国人寿	98,833,319.86	4.37
7	601688	华泰证券	88,752,783.44	3.92
8	002049	紫光国微	88,515,469.20	3.91
9	000333	美的集团	80,846,643.85	3.57
10	300558	贝达药业	77,619,838.73	3.43
11	600570	恒生电子	72,774,178.55	3.22
12	000661	长春高新	71,049,171.44	3.14
13	600999	招商证券	67,607,278.58	2.99
14	000651	格力电器	66,796,290.60	2.95
15	002960	青鸟消防	66,106,440.20	2.92
16	601012	隆基股份	65,485,165.91	2.89
17	603019	中科曙光	64,977,721.70	2.87
18	000001	平安银行	63,106,369.09	2.79
19	600309	万华化学	60,948,360.99	2.69
20	000338	潍柴动力	58,771,334.89	2.60
21	000002	万科 A	57,488,975.29	2.54
22	600271	航天信息	56,347,060.00	2.49
23	000858	五粮液	56,025,614.70	2.48
24	002415	海康威视	49,669,138.71	2.19
25	603486	科沃斯	49,646,058.80	2.19
26	300760	迈瑞医疗	48,681,934.49	2.15

27	600030	中信证券	48,119,606.04	2.13
28	002409	雅克科技	48,073,033.82	2.12
29	000625	长安汽车	47,543,714.83	2.10
30	600131	国网信通	47,297,793.00	2.09
31	600588	用友网络	45,360,022.90	2.00

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	210,054,315.42	9.28
2	601628	中国人寿	197,472,420.67	8.73
3	601688	华泰证券	148,168,821.00	6.55
4	000001	平安银行	137,253,006.48	6.06
5	603517	绝味食品	108,383,496.90	4.79
6	601012	隆基股份	106,546,613.50	4.71
7	600104	上汽集团	106,422,963.33	4.70
8	002008	大族激光	96,823,876.18	4.28
9	603019	中科曙光	95,898,660.91	4.24
10	000961	中南建设	95,867,342.94	4.24
11	600887	伊利股份	94,725,464.33	4.19
12	000002	万科 A	91,823,559.22	4.06
13	600036	招商银行	88,845,234.00	3.93
14	600519	贵州茅台	82,412,786.72	3.64
15	600346	恒力石化	75,483,618.97	3.34
16	600690	海尔智家	71,708,464.42	3.17
17	601318	中国平安	66,979,724.52	2.96
18	601888	中国中免	63,694,870.10	2.81
19	000338	潍柴动力	62,932,428.86	2.78
20	600588	用友网络	59,990,424.91	2.65
21	600999	招商证券	59,244,191.48	2.62
22	601601	中国太保	57,201,381.89	2.53
23	600030	中信证券	56,549,562.15	2.50
24	600276	恒瑞医药	56,410,347.90	2.49
25	600885	宏发股份	56,254,629.81	2.49
26	000977	浪潮信息	53,335,096.70	2.36
27	601668	中国建筑	52,438,099.35	2.32

28	600271	航天信息	51,922,260.24	2.29
29	601799	星宇股份	48,160,051.77	2.13
30	000063	中兴通讯	48,149,084.87	2.13
31	601166	兴业银行	47,979,892.53	2.12
32	000625	长安汽车	46,859,979.33	2.07

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,671,159,586.36
卖出股票收入（成交）总额	4,241,443,323.62

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	483,348.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,040.03
5	应收申购款	1,333,576.63
6	其他应收款	233.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,859,198.05

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
108,968	14,056.42	343,835,676.70	22.45%	1,187,864,439.52	77.55%

### 9.2 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	102,383.68	0.01%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 8 月 11 日）基金份额总额	1,085,604,444.01
本报告期期初基金份额总额	1,718,377,322.51
本报告期基金总申购份额	525,622,211.19
减:本报告期基金总赎回份额	712,299,417.48
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	1,531,700,116.22

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 90,000.00 元。目前的审计机构已连续为本基金提供 17 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	4	898,390,141.81	11.42%	816,334.87	11.85%	-
第一创业证券股份有限公司	2	896,714,904.77	11.40%	835,110.82	12.12%	-
天风证券股份有限公司	3	673,489,430.89	8.56%	579,216.67	8.41%	-

东北证券股份有限公司	4	603,303,013.82	7.67%	561,854.66	8.15%	-
长江证券股份有限公司	2	554,888,708.52	7.05%	516,764.93	7.50%	-
华泰证券股份有限公司	4	537,636,220.66	6.83%	393,163.66	5.71%	-
华创证券有限责任公司	2	451,361,392.95	5.74%	420,352.04	6.10%	-
广发证券股份有限公司	2	450,943,893.12	5.73%	380,735.98	5.53%	-
招商证券股份有限公司	2	355,284,487.87	4.52%	330,877.23	4.80%	-
东方证券股份有限公司	3	346,310,715.26	4.40%	259,208.40	3.76%	-
中国国际金融股份有限公司	2	332,097,224.94	4.22%	309,281.53	4.49%	-
东吴证券股份有限公司	2	296,498,042.18	3.77%	232,103.73	3.37%	-
首创证券有限责任公司	0	268,360,946.87	3.41%	249,924.26	3.63%	撤销 2 个交易单元
中泰证券股份有限公司	1	257,775,644.11	3.28%	240,063.60	3.48%	-
西部证券股份有限公司	3	191,146,473.14	2.43%	139,785.29	2.03%	-
中信证券股份有限公司	2	185,206,027.14	2.35%	135,440.67	1.97%	-
长城证券股份有限公司	3	126,304,735.39	1.61%	117,625.89	1.71%	-
东兴证券股份有限公司	3	123,123,246.23	1.56%	114,665.15	1.66%	-
太平洋证券股份有限公司	4	97,010,770.69	1.23%	70,944.12	1.03%	-
海通证券股份有限公司	2	96,717,040.84	1.23%	70,729.25	1.03%	-
华安证券股份有限公司	1	53,032,479.97	0.67%	49,388.49	0.72%	-
申万宏源集团股份有限公司	2	50,924,432.27	0.65%	47,426.03	0.69%	-
光大证券股份有限公司	2	20,896,908.03	0.27%	19,460.25	0.28%	-

上海证券有 限责任公司	1	442,249.92	0.01%	411.87	0.01%	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
南京证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	3	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
国泰君安证	2	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券华 南股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
万联证券股 份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
华金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
东方财富证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	956,058.07	100.00%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
上海证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证	-	-	-	-	-	-



券股份有限 公司						
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券华 南股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 A 类份额暂停大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	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 1 月 16 日
2	《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
3	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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
4	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 A 类份额分红公告》	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 1 月 20 日

5	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 A 类份额恢复大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	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 2 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的浪潮信息估值方法调整的公告》	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 13 日
7	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金关于道琼斯中国 88 指数推迟指数调整的公告》	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 23 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、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 24 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报、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 28 日
10	《银华-道琼斯 88 精选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 30 日
11	《银华-道琼斯 88 精选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 30 日
12	《银华-道琼斯 88 精选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 30 日
13	《银华-道琼斯 88 精选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 30 日
14	《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 2 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》	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 30 日
15	《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
16	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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
17	《银华基金管理股份有限公司旗	四大证券报	2020 年 4 月 22 日

	下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》		
18	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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
19	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金通过本公司直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告》	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 5 月 7 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金通过本公司直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告》	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 6 月 15 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加手机银行渠道费率优惠活动的公告》	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 6 月 30 日
22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 7 月 18 日
23	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2020 年第 2 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 7 月 18 日
24	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 8 月 28 日
25	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2020 年中期报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
26	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 9 月 1 日
27	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 9 月 23 日
28	《银华-道琼斯 88 精选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 9 月 23 日
29	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 10 月 27 日
30	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2020 年第 3 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 10 月 27 日

31	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 10 月 30 日
32	《银华基金管理股份有限公司关于增加腾安基金销售(深圳)有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 11 月 5 日
33	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 A 类份额暂停大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	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 12 月 22 日
34	《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 A 类份额分红公告》	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 12 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 3 月 30 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 2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会核准银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 3 月 29 日