

银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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
§5 托管人报告	17
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
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
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60

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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	银华沪深 300 指数
场内简称	银华 300
基金主代码	161811
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 30 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,713,242.69 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	2020 年 12 月 15 日

注：本基金的扩位证券简称为沪深 300LOF 银华。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托银华量化投资平台，使用组合优化方法创建投资组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。 基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 95% + 同期银行活期存款利率 (税后) \times 5%
风险收益特征	本基金属于股票指数型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金。 本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国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 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.yhfund.com.cn
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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	10,968,089.80
本期利润	4,888,075.48
加权平均基金份额本期利润	0.0460
本期加权平均净值利润率	4.21%
本期基金份额净值增长率	3.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	50,936,714.36
期末可供分配基金份额利润	0.4864
期末基金资产净值	115,905,853.67
期末基金份额净值	1.1069
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.69%

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

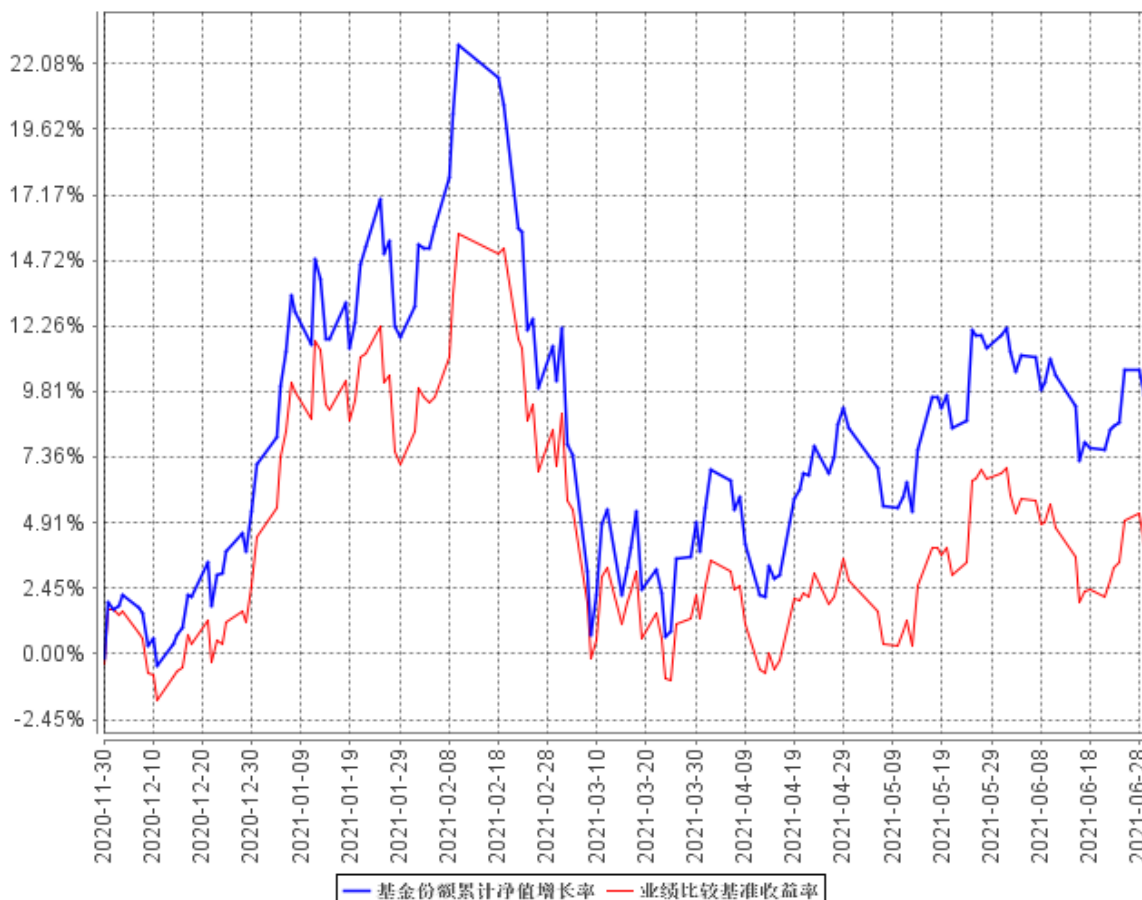
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.08%	0.84%	-1.91%	0.76%	0.83%	0.08%
过去三个月	6.64%	1.04%	3.32%	0.93%	3.32%	0.11%
过去六个月	3.36%	1.44%	0.29%	1.25%	3.07%	0.19%
自基金合同生效起至今	10.69%	1.37%	4.70%	1.20%	5.99%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

本基金以沪深 300 指数为标的指数，原则上将不低于 80%的非现金基金资产投资于沪深 300 指数成份券及备选成份券，选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

3.2.2 自基金转型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：本基金合同生效日期为 2020 年 11 月 30 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，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：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 149 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 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华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证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华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、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（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、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。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	2020 年 11 月 30 日	-	11.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华

				<p>基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日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 11 月 26 日起兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，自 2020 年 11 月 30 日起兼任银华</p>
--	--	--	--	---

					沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2021 年 2 月 3 日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发起式联接基金基金经理, 自 2021 年 5 月 13 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 2021 年 7 月 29 日起兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍: 中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2020 年 11 月 30 日	-	8.5 年	硕士学位, 曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司, 2015 年加入银华基金, 历任量化研究员, 现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍: 中国。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效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》、《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、《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们积极改进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。除此之外运用自行开发的量化投资模型精选个股，力争实现超越基准的阿尔法收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1069 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年中，伴随疫苗产量逐步爬坡，接种比例上升，新冠疫情的阴影正在全球范围内逐步减弱。国内方面，春节假期、五一假期的人口流动都没有产生明显的疫情反复，疫情防控依然维持良好水平；国外方面，尽管部分国家和地区的疫情控制还没有达到理想水平，甚至出现了变异病毒等新情况，但整体上的免疫覆盖度仍处于持续上升中。在此背景下，全球经济复苏的预期有所上升，这在利率、贵金属等资产价格的波动上有所反应。这种波动也反过来对权益市场的估值产生了一定的影响。A 股市场在上半年中波动加大，且风格轮动明显：消费、金融等行业有

所调整，而周期资源类行业估值提升。行业层面，基础化工、钢铁、电力设备新能源等行业表现良好，非银行金融、家电、军工等行业表现落后。

展望下半年我们认为，全球疫情的消退、经济的复苏已经形成明显趋势，局部的反复无法阻挡这一整体趋势。从全球范围来看，消费需求的复苏、刺激政策的退出、货币政策的正常化都将是接下来一段时期的主基调。在这一背景下，A 股市场仍将持续出现机会。我们需要关注的风险点在于国际摩擦等黑天鹅事件。在此过程中，我们持续看好各行业龙头公司的超额收益。

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，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,950,002.17	9,725,712.87
结算备付金		223,840.86	468,007.03
存出保证金		15,055.37	53,924.46
交易性金融资产	6.4.7.2	106,368,802.64	108,240,889.22
其中：股票投资		106,368,802.64	108,240,889.22
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		109,921.28	-
应收利息	6.4.7.5	1,090.86	1,509.13
应收股利		-	-
应收申购款		141,042.45	454,828.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		116,809,755.63	118,944,871.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		588,620.13	541,366.10
应付管理人报酬		95,146.62	98,006.46
应付托管费		20,932.24	21,561.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,748.44	87,044.22
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	166,454.53	219,758.66
负债合计		903,901.96	967,736.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	64,969,139.31	68,355,185.61
未分配利润	6.4.7.10	50,936,714.36	49,621,949.16
所有者权益合计		115,905,853.67	117,977,134.77
负债和所有者权益总计		116,809,755.63	118,944,871.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1069 元，基金份额总额 104,713,242.69 份。

6.2 利润表

会计主体：银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		6,118,601.76
1.利息收入		20,097.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,097.03
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）		12,067,783.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,362,462.61
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		-
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	705,320.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,080,014.32
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	110,736.04
减：二、费用		1,230,526.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	578,826.87

2. 托管费	6.4.10.2.2	127,341.88
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	311,076.63
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	213,280.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,888,075.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,888,075.48

注：本基金转型合同生效日为 2020 年 11 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	68,355,185.61	49,621,949.16	117,977,134.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,888,075.48	4,888,075.48
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）	-3,386,046.30	-3,573,310.28	-6,959,356.58
其中：1.基金申购款	24,803,950.59	19,365,888.11	44,169,838.70
2.基金赎回款	-28,189,996.89	-22,939,198.39	-51,129,195.28
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）	64,969,139.31	50,936,714.36	115,905,853.67

注：本基金转型合同生效日为 2020 年 11 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
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

银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型而成，原基金系由银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）转型而成。银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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[2009]793 号文《关于核准银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2009 年 9 月 4 日至 2009 年 9 月 30 日向社会公开募集，首次募集规模为 670,189,105.75 份基金份额。基金合同于 2009 年 10 月 14 日生效。自 2014 年 1 月 7 日起，《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效且《银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》生效，同时“银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）”更名为“银华沪深 300 指数分级证券投资基金”。根据 2020 年 10 月 29 日《关于银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，银华沪深 300 指数分级证券投资基金转型为本基金。基金托管人与注册登记机构不变。《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2020 年 11 月 30 日生效，转型后的基金按照《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的相关约定进行运作。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、活期存款及其他银行存款）、股指期货、股票期权、资产支持证券、现金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，本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比

例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率（税后） \times 5%。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	9,950,002.17
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：	9,950,002.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	100,651,260.90	106,368,802.64	5,717,541.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	100,651,260.90	106,368,802.64	5,717,541.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	981.85
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	100.70
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	1.51
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	6.80
合计	1,090.86

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	32,748.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,748.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	915.64
应付证券出借违约金	-
其他	3,963.25
预提费用	111,575.64
指数使用费	50,000.00
合计	166,454.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,170,586.95	68,355,185.61
本期申购	39,977,583.19	24,803,950.59
本期赎回(以“-”号填列)	-45,434,927.45	-28,189,996.89
- 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	104,713,242.69	64,969,139.31

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	56,576,183.45	-6,954,234.29	49,621,949.16
本期利润	10,968,089.80	-6,080,014.32	4,888,075.48
本期基金份额交易产生的变动数	-3,107,738.73	-465,571.55	-3,573,310.28
其中：基金申购款	23,083,356.29	-3,717,468.18	19,365,888.11
基金赎回款	-26,191,095.02	3,251,896.63	-22,939,198.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,436,534.52	-13,499,820.16	50,936,714.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	2,417.84
其他	389.67
合计	20,097.03

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	189,192,261.44
减：卖出股票成本总额	177,829,798.83
买卖股票差价收入	11,362,462.61

6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	705,320.40
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	705,320.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,080,014.32
——股票投资	-6,080,014.32
——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	-6,080,014.32

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	110,736.04
合计	110,736.04

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	311,076.63
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	311,076.63

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行费用	1,705.26
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	213,280.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金管理人于 2021 年 6 月 17 日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华国际资本管理有限公司增加注册资本的公告》，银华基金管理股份有限公司（以下简称“母公司”）已完成对银华国际资本管理有限公司（以下简称“香港子公司”）的增资工作，母公司向香港子公司增加注册资本金共港币 7,000 万元。增资完成后，母公司维持持股比例 100%，共持股 1 亿股，香港子公司注册资本为 1 亿元港币。

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
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

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

本基金转型合同生效日为 2020 年 11 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	578,826.87	-
其中：支付销售机构的客户维护费	138,018.03	-

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	127,341.88	-

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 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,950,002.17	17,289.52	-	-

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688216	气派科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 23 日	新发流通受限	14.82	47.64	1,550	22,971.00	73,842.00	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	938	20,598.48	20,598.48	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

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

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 2021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	9,950,002.17	-	-	-	-	-	9,950,002.17
结算备付金	223,840.86	-	-	-	-	-	223,840.86
存出保证金	15,055.37	-	-	-	-	-	15,055.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	106,368,802.64	106,368,802.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	109,921.28	109,921.28
应收利息	-	-	-	-	-	1,090.86	1,090.86
应收申购款	200.00	-	-	-	-	140,842.45	141,042.45
资产总计	10,189,098.40	-	-	-	-	106,620,657.23	116,809,755.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	588,620.13	588,620.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	95,146.62	95,146.62
应付托管费	-	-	-	-	-	20,932.24	20,932.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,748.44	32,748.44
其他负债	-	-	-	-	-	166,454.53	166,454.53
负债总计	-	-	-	-	-	903,901.96	903,901.96
利率敏感度缺口	10,189,098.40	-	-	-	-	105,716,755.27	115,905,853.67
上年度末 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	9,725,712.87	-	-	-	-	-	9,725,712.87
结算备付金	468,007.03	-	-	-	-	-	468,007.03
存出保证金	53,924.46	-	-	-	-	-	53,924.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	108,240,889.22	108,240,889.22
应收利息	-	-	-	-	-	1,509.13	1,509.13
应收申购款	-	-	-	-	-	454,828.90	454,828.90
资产总计	10,247,644.36	-	-	-	-	108,697,227.25	118,944,871.61

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	541,366.10	541,366.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	98,006.46	98,006.46
应付托管费	-	-	-	-	-	21,561.40	21,561.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	87,044.22	87,044.22
其他负债	-	-	-	-	-	219,758.66	219,758.66
负债总计	-	-	-	-	-	967,736.84	967,736.84
利率敏感度缺口	10,247,644.36	-	-	-	-	-107,729,490.41	-117,977,134.77

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	106,368,802.64	91.77	108,240,889.22	91.75
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	106,368,802.64	91.77	108,240,889.22	91.75

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,448,031.54	5,554,010.59
	业绩比较基准下降 5%	-6,448,031.54	-5,554,010.59

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

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	106,368,802.64	91.06
	其中：股票	106,368,802.64	91.06
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	10,173,843.03	8.71
8	其他各项资产	267,109.96	0.23
9	合计	116,809,755.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	555,225.78	0.48
B	采矿业	3,195,144.35	2.76
C	制造业	55,520,977.50	47.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,498,966.99	1.29
E	建筑业	1,366,151.80	1.18
F	批发和零售业	93,107.91	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,148,469.37	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,207,612.31	2.77
J	金融业	24,475,436.02	21.12
K	房地产业	2,136,648.02	1.84
L	租赁和商务服务业	2,899,735.34	2.50
M	科学研究和技术服务业	2,892,843.66	2.50
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,958,840.98	2.55
R	文化、体育和娱乐业	516,427.64	0.45
S	综合	-	-
	合计	103,465,587.67	89.27

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	322,396.00	0.28
C	制造业	1,763,881.54	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,269.00	0.03
E	建筑业	64,309.44	0.06
F	批发和零售业	35,191.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	175,368.72	0.15
H	住宿和餐饮业	27,791.60	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,913.03	0.09
J	金融业	261,889.80	0.23
K	房地产业	52,079.84	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	55,125.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,903,214.97	2.50

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	71,306	3,864,072.14	3.33
2	600519	贵州茅台	1,838	3,780,214.60	3.26
3	000858	五粮液	11,757	3,502,292.73	3.02
4	002415	海康威视	51,702	3,334,779.00	2.88
5	603259	药明康德	18,474	2,892,843.66	2.50
6	300059	东方财富	85,449	2,801,872.71	2.42
7	600809	山西汾酒	5,944	2,662,912.00	2.30
8	601012	隆基股份	29,353	2,607,720.52	2.25
9	601318	中国平安	37,641	2,419,563.48	2.09
10	601888	中国中免	8,057	2,417,905.70	2.09
11	300122	智飞生物	12,334	2,303,127.82	1.99
12	300347	泰格医药	11,344	2,192,795.20	1.89
13	600132	重庆啤酒	10,825	2,142,808.75	1.85
14	601166	兴业银行	101,464	2,085,085.20	1.80
15	000568	泸州老窖	8,559	2,019,410.46	1.74
16	603501	韦尔股份	6,070	1,954,540.00	1.69
17	300595	欧普康视	17,900	1,853,545.00	1.60
18	000001	平安银行	81,535	1,844,321.70	1.59
19	002142	宁波银行	44,626	1,739,075.22	1.50
20	601899	紫金矿业	146,990	1,424,333.10	1.23
21	600900	长江电力	68,982	1,423,788.48	1.23
22	002812	恩捷股份	5,642	1,320,792.20	1.14
23	600919	江苏银行	184,132	1,307,337.20	1.13
24	002179	中航光电	16,082	1,270,799.64	1.10
25	600690	海尔智家	46,221	1,197,586.11	1.03
26	601658	邮储银行	236,964	1,189,559.28	1.03
27	300124	汇川技术	15,729	1,168,035.54	1.01
28	000651	格力电器	20,732	1,080,137.20	0.93
29	600309	万华化学	9,862	1,073,182.84	0.93
30	601668	中国建筑	221,514	1,030,040.10	0.89
31	601021	春秋航空	17,868	1,016,689.20	0.88
32	600383	金地集团	97,265	995,993.60	0.86
33	601601	中国太保	33,443	968,843.71	0.84

34	600570	恒生电子	10,248	955,626.00	0.82
35	000661	长春高新	2,404	930,348.00	0.80
36	688396	华润微	9,905	901,553.10	0.78
37	002311	海大集团	10,953	893,764.80	0.77
38	688169	石头科技	700	882,700.00	0.76
39	002410	广联达	12,734	868,458.80	0.75
40	002271	东方雨虹	15,648	865,647.36	0.75
41	000063	中兴通讯	25,888	860,258.24	0.74
42	600030	中信证券	30,630	763,912.20	0.66
43	601398	工商银行	146,252	756,122.84	0.65
44	601009	南京银行	68,812	723,902.24	0.62
45	601799	星宇股份	3,100	699,732.00	0.60
46	601995	中金公司	11,300	694,950.00	0.60
47	000333	美的集团	9,437	673,518.69	0.58
48	600999	招商证券	35,403	673,365.06	0.58
49	601100	恒立液压	7,491	643,626.72	0.56
50	600426	华鲁恒升	19,500	603,525.00	0.52
51	002050	三花智控	24,931	597,845.38	0.52
52	600660	福耀玻璃	10,685	596,757.25	0.51
53	002352	顺丰控股	8,509	576,059.30	0.50
54	000786	北新建材	14,459	567,515.75	0.49
55	000002	万科 A	23,333	555,558.73	0.48
56	002714	牧原股份	9,129	555,225.78	0.48
57	601857	中国石油	104,798	554,381.42	0.48
58	601225	陕西煤业	45,987	544,945.95	0.47
59	600031	三一重工	17,779	516,835.53	0.45
60	002027	分众传媒	51,204	481,829.64	0.42
61	600176	中国巨石	30,656	475,474.56	0.41
62	600837	海通证券	40,509	465,853.50	0.40
63	002821	凯莱英	1,234	459,788.40	0.40
64	603658	安图生物	5,557	421,053.89	0.36
65	000100	TCL 科技	54,599	417,682.35	0.36
66	603986	兆易创新	2,221	417,325.90	0.36
67	000725	京东方 A	66,481	414,841.44	0.36
68	600276	恒瑞医药	6,086	413,665.42	0.36
69	603899	晨光文具	4,751	401,744.56	0.35
70	601336	新华保险	8,632	396,295.12	0.34
71	300015	爱尔眼科	5,436	385,847.28	0.33
72	000708	中信特钢	18,302	381,413.68	0.33

73	000596	古井贡酒	1,584	379,368.00	0.33
74	002230	科大讯飞	5,335	360,539.30	0.31
75	300014	亿纬锂能	3,444	357,934.92	0.31
76	600048	保利地产	28,109	338,432.36	0.29
77	603338	浙江鼎力	5,753	337,643.57	0.29
78	600763	通策医疗	789	324,279.00	0.28
79	002304	洋河股份	1,553	321,781.60	0.28
80	002049	紫光国微	2,007	309,459.33	0.27
81	300601	康泰生物	2,057	306,493.00	0.26
82	002739	万达电影	19,316	304,999.64	0.26
83	600887	伊利股份	8,209	302,337.47	0.26
84	002475	立讯精密	6,259	287,914.00	0.25
85	002460	赣锋锂业	2,372	287,225.48	0.25
86	601808	中海油服	19,775	283,969.00	0.24
87	600019	宝钢股份	37,043	283,008.52	0.24
88	601211	国泰君安	16,475	282,381.50	0.24
89	688111	金山办公	700	276,360.00	0.24
90	601186	中国铁建	36,906	274,211.58	0.24
91	000977	浪潮信息	9,723	273,507.99	0.24
92	002555	三七互娱	11,188	268,735.76	0.23
93	603799	华友钴业	2,247	256,607.40	0.22
94	600588	用友网络	7,644	254,239.44	0.22
95	300529	健帆生物	2,890	249,580.40	0.22
96	601088	中国神华	12,719	248,274.88	0.21
97	600741	华域汽车	9,258	243,207.66	0.21
98	600989	宝丰能源	17,566	240,302.88	0.21
99	688363	华熙生物	800	222,288.00	0.19
100	603392	万泰生物	821	212,786.78	0.18
101	600926	杭州银行	13,296	196,116.00	0.17
102	300408	三环集团	4,538	192,501.96	0.17
103	000625	长安汽车	7,308	192,054.24	0.17
104	601633	长城汽车	4,158	181,247.22	0.16
105	002493	荣盛石化	10,101	174,444.27	0.15
106	300144	宋城演艺	10,135	170,268.00	0.15
107	600346	恒力石化	6,325	165,968.00	0.14
108	601919	中远海控	5,166	157,769.64	0.14
109	603833	欧派家居	1,107	157,149.72	0.14
110	600009	上海机场	3,176	152,860.88	0.13
111	688036	传音控股	700	146,650.00	0.13

112	000338	潍柴动力	7,943	141,941.41	0.12
113	600438	通威股份	3,130	135,435.10	0.12
114	600436	片仔癀	300	134,490.00	0.12
115	601628	中国人寿	3,788	128,375.32	0.11
116	600000	浦发银行	12,100	121,000.00	0.10
117	603288	海天味业	927	119,536.65	0.10
118	601006	大秦铁路	18,018	118,558.44	0.10
119	600028	中国石化	26,400	115,104.00	0.10
120	002241	歌尔股份	2,690	114,970.60	0.10
121	600104	上汽集团	5,200	114,244.00	0.10
122	600522	中天科技	11,347	113,470.00	0.10
123	002594	比亚迪	446	111,946.00	0.10
124	603195	公牛集团	550	111,100.00	0.10
125	000157	中联重科	11,822	109,235.28	0.09
126	002938	鹏鼎控股	3,014	108,142.32	0.09
127	601988	中国银行	34,500	106,260.00	0.09
128	601688	华泰证券	6,074	95,969.20	0.08
129	600061	国投资本	10,898	92,524.02	0.08
130	002624	完美世界	3,705	88,586.55	0.08
131	601998	中信银行	17,220	87,822.00	0.08
132	601288	农业银行	28,100	85,143.00	0.07
133	000069	华侨城 A	10,600	78,864.00	0.07
134	601238	广汽集团	5,867	75,977.65	0.07
135	601818	光大银行	19,620	74,163.60	0.06
136	000656	金科股份	12,527	72,531.33	0.06
137	601377	兴业证券	7,396	71,445.36	0.06
138	600111	北方稀土	3,381	69,986.70	0.06
139	603659	璞泰来	500	68,300.00	0.06
140	000776	广发证券	4,473	67,721.22	0.06
141	601390	中国中铁	11,813	61,900.12	0.05
142	600050	中国联通	14,138	61,076.16	0.05
143	601838	成都银行	4,752	60,065.28	0.05
144	603882	金城医学	350	55,919.50	0.05
145	601229	上海银行	6,700	54,940.00	0.05
146	601555	东吴证券	6,524	54,410.16	0.05
147	600085	同仁堂	1,300	53,105.00	0.05
148	000895	双汇发展	1,618	51,452.40	0.04
149	002773	康弘药业	1,981	45,820.53	0.04
150	601985	中国核电	8,975	45,413.50	0.04

151	601169	北京银行	9,201	44,808.87	0.04
152	600183	生益科技	1,900	44,479.00	0.04
153	603369	今世缘	800	43,328.00	0.04
154	001979	招商蛇口	3,925	42,978.75	0.04
155	600018	上港集团	9,000	42,930.00	0.04
156	002129	中环股份	1,100	42,460.00	0.04
157	600600	青岛啤酒	360	41,634.00	0.04
158	300413	芒果超媒	600	41,160.00	0.04
159	600845	宝信软件	807	41,076.30	0.04
160	002001	新和成	1,412	40,496.16	0.03
161	601319	中国人保	6,700	39,731.00	0.03
162	600521	华海药业	1,800	37,584.00	0.03
163	601816	京沪高铁	6,800	35,972.00	0.03
164	600109	国金证券	2,800	35,532.00	0.03
165	300628	亿联网络	400	33,520.00	0.03
166	002153	石基信息	1,400	32,914.00	0.03
167	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.03
168	603233	大参林	600	30,666.00	0.03
169	600233	圆通速递	2,963	29,659.63	0.03
170	601328	交通银行	5,888	28,851.20	0.02
171	601155	新城控股	620	25,792.00	0.02
172	300677	英科医疗	200	24,960.00	0.02
173	603019	中科曙光	892	24,628.12	0.02
174	600489	中金黄金	2,800	24,136.00	0.02
175	600606	绿地控股	4,205	22,917.25	0.02
176	603939	益丰药房	400	22,436.00	0.02
177	601933	永辉超市	4,567	21,601.91	0.02
178	002414	高德红外	748	20,629.84	0.02
179	000963	华东医药	400	18,404.00	0.02
180	600795	国电电力	7,007	17,027.01	0.01
181	601877	正泰电器	500	16,690.00	0.01
182	601696	中银证券	782	16,101.38	0.01
183	601108	财通证券	1,533	16,081.17	0.01
184	300136	信维通信	500	15,440.00	0.01
185	600703	三安光电	478	15,319.90	0.01
186	601111	中国国航	1,885	14,665.30	0.01
187	600025	华能水电	2,200	12,738.00	0.01
188	600872	中炬高新	300	12,606.00	0.01
189	000783	长江证券	1,600	11,712.00	0.01

190	600705	中航资本	1,922	7,438.14	0.01
191	600848	上海临港	200	3,580.00	0.00
192	601231	环旭电子	200	3,362.00	0.00
193	600029	南方航空	549	3,304.98	0.00
194	600079	人福医药	100	2,827.00	0.00
195	601236	红塔证券	200	2,712.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	688	367,942.40	0.32
2	600188	兖州煤业	14,100	216,576.00	0.19
3	600390	五矿资本	24,965	149,290.70	0.13
4	601898	中煤能源	14,800	105,820.00	0.09
5	600740	山西焦化	20,400	103,632.00	0.09
6	300760	迈瑞医疗	200	96,010.00	0.08
7	601689	拓普集团	2,300	86,089.00	0.07
8	002139	拓邦股份	4,657	83,779.43	0.07
9	600779	水井坊	600	75,810.00	0.07
10	688216	气派科技	1,550	73,842.00	0.06
11	300146	汤臣倍健	1,753	57,673.70	0.05
12	002245	蔚蓝锂芯	2,900	57,130.00	0.05
13	603127	昭衍新药	300	55,125.00	0.05
14	603260	合盛硅业	700	53,837.00	0.05
15	600039	四川路桥	8,500	53,295.00	0.05
16	300782	卓胜微	99	53,212.50	0.05
17	300496	中科创达	323	50,730.38	0.04
18	002250	联化科技	1,700	47,430.00	0.04
19	600663	陆家嘴	3,500	46,620.00	0.04
20	601636	旗滨集团	2,500	46,400.00	0.04
21	001872	招商港口	2,600	43,992.00	0.04
22	600549	厦门钨业	2,000	41,660.00	0.04
23	002597	金禾实业	1,200	41,640.00	0.04
24	002777	久远银海	2,300	40,687.00	0.04
25	601577	长沙银行	4,500	40,230.00	0.03
26	002568	百润股份	420	39,811.80	0.03
27	600023	浙能电力	10,700	39,269.00	0.03

28	603267	鸿远电子	300	38,376.00	0.03
29	601018	宁波港	9,600	37,920.00	0.03
30	000627	天茂集团	10,400	37,648.00	0.03
31	000830	鲁西化工	2,000	37,460.00	0.03
32	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.03
33	600377	宁沪高速	3,722	36,326.72	0.03
34	601233	桐昆股份	1,500	36,135.00	0.03
35	002025	航天电器	700	35,119.00	0.03
36	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
37	601882	海天精工	2,200	34,210.00	0.03
38	000012	南玻 A	3,300	33,792.00	0.03
39	600801	华新水泥	1,700	29,869.00	0.03
40	600089	特变电工	2,300	29,555.00	0.03
41	300755	华致酒行	700	28,567.00	0.02
42	600754	锦江酒店	488	27,791.60	0.02
43	000807	云铝股份	2,300	27,370.00	0.02
44	002920	德赛西威	244	26,859.52	0.02
45	002677	浙江美大	1,200	21,936.00	0.02
46	600066	宇通客车	1,712	21,382.88	0.02
47	688087	英科再生	938	20,598.48	0.02
48	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
49	603877	太平鸟	300	16,014.00	0.01
50	000488	晨鸣纸业	1,800	14,652.00	0.01
51	603613	国联股份	145	14,495.65	0.01
52	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
53	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
54	600297	广汇汽车	2,300	6,624.00	0.01
55	600208	新湖中宝	1,796	5,459.84	0.00
56	600177	雅戈尔	544	3,584.96	0.00
57	603638	艾迪精密	1	42.87	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,174,164.00	3.54

2	600809	山西汾酒	4,035,609.00	3.42
3	002415	海康威视	3,578,792.00	3.03
4	300059	东方财富	3,236,803.77	2.74
5	601166	兴业银行	3,114,957.21	2.64
6	601318	中国平安	3,065,911.00	2.60
7	000858	五粮液	2,854,452.00	2.42
8	603501	韦尔股份	2,547,042.00	2.16
9	603259	药明康德	2,448,112.60	2.08
10	300122	智飞生物	2,447,381.00	2.07
11	300347	泰格医药	2,434,922.00	2.06
12	600309	万华化学	2,333,660.00	1.98
13	601888	中国中免	2,329,477.98	1.97
14	000333	美的集团	2,324,149.31	1.97
15	600036	招商银行	2,213,078.00	1.88
16	601012	隆基股份	2,065,189.00	1.75
17	000568	泸州老窖	1,996,220.00	1.69
18	600132	重庆啤酒	1,961,317.00	1.66
19	601601	中国太保	1,947,722.00	1.65
20	300595	欧普康视	1,909,845.20	1.62

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	601166	兴业银行	4,322,282.21	3.66
2	000568	泸州老窖	4,169,340.70	3.53
3	601318	中国平安	4,092,803.43	3.47
4	600438	通威股份	3,740,263.16	3.17
5	000333	美的集团	3,588,988.50	3.04
6	600887	伊利股份	3,423,673.38	2.90
7	600519	贵州茅台	3,376,017.98	2.86
8	300122	智飞生物	3,126,453.87	2.65
9	600809	山西汾酒	2,979,792.46	2.53
10	300059	东方财富	2,528,554.80	2.14
11	601012	隆基股份	2,496,746.11	2.12
12	600309	万华化学	2,474,491.42	2.10

13	601211	国泰君安	2,414,391.37	2.05
14	000725	京东方 A	2,410,836.03	2.04
15	601601	中国太保	2,377,220.82	2.01
16	300015	爱尔眼科	2,300,371.14	1.95
17	000858	五粮液	2,223,285.24	1.88
18	300601	康泰生物	2,172,689.47	1.84
19	002311	海大集团	2,041,526.64	1.73
20	300124	汇川技术	2,030,511.39	1.72

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	182,037,726.57
卖出股票收入（成交）总额	189,192,261.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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

注：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	15,055.37
2	应收证券清算款	109,921.28
3	应收股利	-
4	应收利息	1,090.86
5	应收申购款	141,042.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,109.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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
14,455	7,244.08	18,049.00	0.02%	104,695,193.69	99.98%

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	李祖平	2,254,683.00	17.37%
2	陈淑芬	983,454.00	7.58%
3	广发证券股份有限公司客户信用交 易担保证券账户	559,102.00	4.31%
4	迟振才	500,212.00	3.85%
5	符安民	479,858.00	3.70%
6	蒋江	327,605.00	2.52%
7	郑卫华	312,957.00	2.41%
8	黄月梅	306,854.00	2.36%
9	杨焕	301,071.00	2.32%
10	张平平	234,561.00	1.81%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	540,325.59	0.52%

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

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 11 月 30 日）基金份额总额	128,082,065.32
本报告期期初基金份额总额	110,170,586.95
本报告期基金总申购份额	39,977,583.19
减:本报告期基金总赎回份额	45,434,927.45
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	104,713,242.69

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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

本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起在投资范围中增加存托凭证，并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

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	
东方财富证券股份有限公司	2	369,884,305.61	100.00%	85,560.87	100.00%	-
东莞证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中信证券华	1	-	-	-	-	-

南股份有限 公司						
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股 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	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	4	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股	4	-	-	-	-	-

份有限公司						
东方证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
红塔证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	3	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
南京证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有公	1	-	-	-	-	-

司						
第一创业证 券股份有 限公 司	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责 任公 司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有 限公 司	2	-	-	-	-	-
中国际金 融股份有 限公 司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有 限公 司	1	-	-	-	-	-
财通证券股 份有限公 司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公 司	3	-	-	-	-	-

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
东方财富证 券股份有 限公 司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股 份有限公 司	-	-	-	-	-	-
方正证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
中信证券华 南股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 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	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股 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	-	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金于本报告期末运用交易单元进行债券交易、权证交易、债券回购交易。

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 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 1 月 20 日
2	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 20 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
4	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2021 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
5	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
6	《银华沪深 300 指数证券投资基金	本基金管理人网站,	2021 年 1 月 29 日

	(LOF) 基金合同 (2021 年 1 月修订)》	中国证监会基金电子披露网站	
7	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议 (2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
8	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 3 月 29 日
9	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 29 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下全部公募指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
11	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
12	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2021 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
13	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同 (2021 年 3 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 20 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 4 月 21 日
16	《银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
17	《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》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 11 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

2、本基金管理人于 2021 年 3 月 30 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下全部公募指数基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同部分条款的公告》，对本基金基金合同进行了修订，补充了关于指数不符合要求、指数编制机构退出等情形时的应急处置安排，明确了基金运作过程中标的指数成份证券面临退市或违约风险时的处置措施等。本次修订自 2021 年 3 月 30 日起正式生效。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准银华沪深 300 指数分级证券投资基金募集的文件及中国证监会准予银华沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册为银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的文件

12.1.2 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》

12.1.3 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》

12.1.4 《银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 28 日