银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金
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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 44
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 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44

§8 基金份额持有人信息 45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末上市基金前十名持有人 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 46

§9 开放式基金份额变动 46

§10 重大事件揭示 47

10.1 基金份额持有人大会决议 47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 48

§11 影响投资者决策的其他重要信息 50

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 50

§12 备查文件目录 50

12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创新 ETF
场内简称	创新 ETF
基金主代码	159987
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,457,627.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 11 月 18 日

注：本基金的扩位证券简称为科技创新 ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证研发创新 100 指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	韩鑫普
	联系电话	(010)58163000	0755-82943666
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95565
传真		(010)58163027	0755-82960794
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特	深圳市福田区福田街道福华一

	区报业大厦 19 层	路 111 号
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	100738	518000
法定代表人	王珠林	霍达

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	17,981,916.11
本期利润	12,157,149.16
加权平均基金份额本期利润	0.1744
本期加权平均净值利润率	10.39%
本期基金份额净值增长率	12.13%
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	46,376,134.32
期末可供分配基金份额利润	0.7671
期末基金资产净值	112,534,350.25
期末基金份额净值	1.8614
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	86.14%

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。

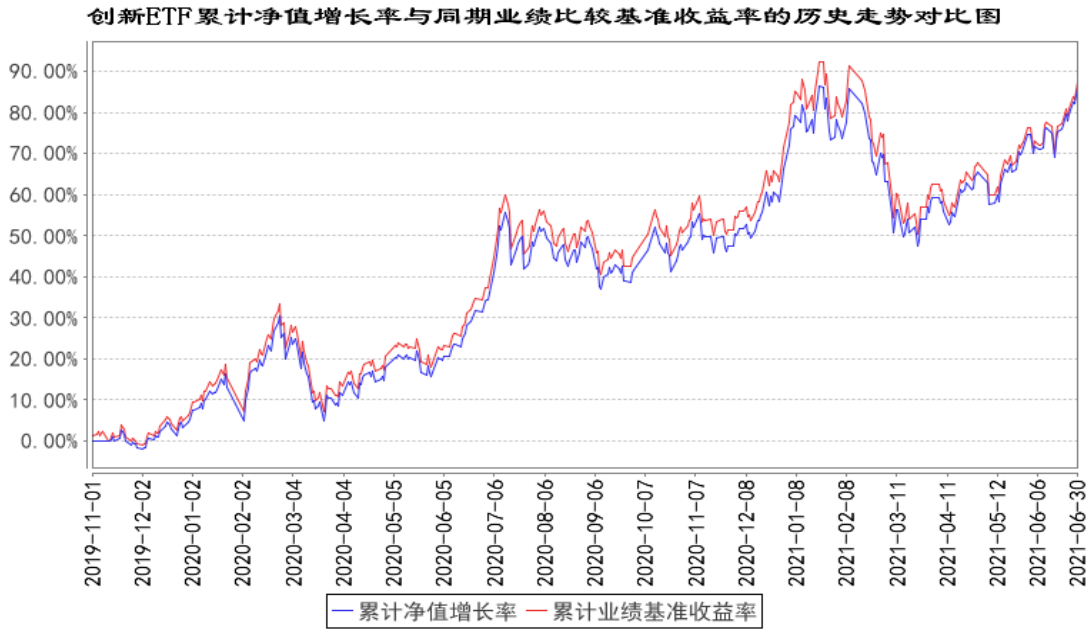
3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去一个月	6.61%	1.43%	6.32%	1.49%	0.29%	-0.06%
过去三个月	19.49%	1.38%	18.01%	1.43%	1.48%	-0.05%
过去六个月	12.13%	1.77%	9.39%	1.83%	2.74%	-0.06%
过去一年	38.84%	1.70%	36.58%	1.74%	2.26%	-0.04%
自基金合同生效起至今	86.14%	1.69%	87.41%	1.74%	-1.27%	-0.05%

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



注：按基金合同规定，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：本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低

于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 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、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	本基金的	2021 年 5	-	11.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月

先生	基金经理	月 13 日			加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日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。
张亦驰先生	本基金的基金经理	2021 年 5 月 25 日	-	6.5 年	硕士学位，曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015 年 10 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2021 年 5 月 25 日起担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、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。具有从业资格。国籍：中国。
王 帅先生	本基金的基金经理	2019 年 11 月 1 日	2021 年 5 月 19 日	8.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 12 月 10 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 4 月 29 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 29 日起兼任银华中证科创创业 50 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。

谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2019 年 11 月 1 日	-	9.5 年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
刘文魁先生	本基金的基金经理助理	2019 年 11 月 1 日	-	7 年	硕士学位。曾就职于艾派迪财团、佛罗里达大学商学院、华夏基金管理有限公司。2015 年 5 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2021 年 4 月 19 日		8 年	学士学位。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，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、《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综

合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

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

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次，原因是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

2021 年上半年，伴随疫苗产量的逐步提高，接种比例的不断上升，新冠疫情的阴影正在全球范围内逐渐减弱。国内方面，春节假期和五一假期的人口流动均未产生明显的疫情反复，疫情的防控依旧维持在一个良好的水平；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的水平，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。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.8614 元，本报告期份额净值增长率为 12.13%，同期业绩比较基准收益率为 9.39%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.20%之内，年化跟踪误差控制在 2%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，全球疫情的消退和经济的复苏已经形成明显的趋势，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、刺激政策的退出和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。整体来说，我们对 2021 年下半年的市场持谨慎乐观态度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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：银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

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	5,091,457.55	3,091,581.41
结算备付金		139,341.11	13,828.46
存出保证金		88,924.47	144,580.49
交易性金融资产	6.4.7.2	107,687,735.00	115,826,983.40
其中：股票投资		107,687,735.00	115,826,983.40
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		1,909,038.50	12,884.41
应收利息	6.4.7.5	2,380.03	1,506.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	81,899.70	-
资产总计		115,000,776.36	119,091,364.32
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		2,271,023.68	189,063.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		27,653.99	29,323.86
应付托管费		7,374.41	7,819.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,071.47	37,034.30

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	119,302.56	205,000.00
负债合计		2,466,426.11	468,240.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,457,627.00	71,457,627.00
未分配利润	6.4.7.10	52,076,723.25	47,165,496.35
所有者权益合计		112,534,350.25	118,623,123.35
负债和所有者权益总计		115,000,776.36	119,091,364.32

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8614 元，基金份额总额 60,457,627.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		12,749,059.67	47,145,467.52
1.利息收入		32,399.88	60,312.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,399.88	60,312.58
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）		18,436,971.45	38,588,990.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,017,897.43	37,897,455.14
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	419,074.02	691,535.02

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,824,766.95	7,930,585.01
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	104,455.29	565,579.77
减：二、费用		591,910.51	1,103,294.90
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	174,742.00	286,657.04
2．托管费	6.4.10.2.2	46,597.90	76,441.89
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	148,167.75	546,334.59
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	222,402.86	193,861.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,157,149.16	46,042,172.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,157,149.16	46,042,172.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

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)	71,457,627.00	47,165,496.35	118,623,123.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,157,149.16	12,157,149.16
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）	-11,000,000.00	-7,245,922.26	-18,245,922.26
其中：1.基金申购款	48,000,000.00	33,476,513.18	81,476,513.18
2.基金赎	-59,000,000.00	-40,722,435.44	-99,722,435.44

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	60,457,627.00	52,076,723.25	112,534,350.25

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	218,457,627.00	11,051,553.32	229,509,180.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,042,172.62	46,042,172.62
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）	-118,000,000.00	-22,869,562.59	-140,869,562.59
其中：1.基金申购款	256,000,000.00	42,936,115.12	298,936,115.12
2.基金赎回款	-374,000,000.00	-65,805,677.71	-439,805,677.71
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)	100,457,627.00	34,224,163.35	134,681,790.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新	凌宇翔	伍军辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019] 1737 号《关于准予银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 443,434,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0609 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2019 年 11 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 443,457,627.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,627.00 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”) 深证上[2019]719 号核准，本基金 443,457,627.00 份基金份额于 2019 年 11 月 18 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券资产(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等)、银行存款(包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具(股指期货、期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为：中证研发创新 100 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 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合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	5,091,457.55
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	5,091,457.55

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		89,917,388.90	107,687,735.00	17,770,346.10
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		89,917,388.90	107,687,735.00	17,770,346.10

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	2,305.78
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	34.25
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	40.00
合计	2,380.03

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	81,899.70
合计	81,899.70

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	41,071.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,071.47

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
合计	119,302.56

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	71,457,627.00	71,457,627.00
本期申购	48,000,000.00	48,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-59,000,000.00	-59,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	60,457,627.00	60,457,627.00

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	36,344,330.56	10,821,165.79	47,165,496.35
本期利润	17,981,916.11	-5,824,766.95	12,157,149.16
本期基金份额交易产生的变动数	-7,950,112.35	704,190.09	-7,245,922.26
其中：基金申购款	28,984,184.65	4,492,328.53	33,476,513.18
基金赎回款	-36,934,297.00	-3,788,138.44	-40,722,435.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,376,134.32	5,700,588.93	52,076,723.25

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	30,910.67
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	745.58
其他	743.63
合计	32,399.88

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,028,388.95
股票投资收益——赎回差价收入	9,989,508.48
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	18,017,897.43

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,829,678.19
减：卖出股票成本总额	46,801,289.24
买卖股票差价收入	8,028,388.95

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	99,722,435.44
减：现金支付赎回款总额	36,027,761.44
减：赎回股票成本总额	53,705,165.52
赎回差价收入	9,989,508.48

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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	419,074.02
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	419,074.02

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	-5,824,766.95
股票投资	-5,824,766.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,824,766.95

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	-
替代损益	104,455.29
合计	104,455.29

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	148,167.75
银行间市场交易费用	-
合计	148,167.75

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
登记结算费	68,100.30
合计	222,402.86

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
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、一级交易商

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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（%）
招商证券股份有限公司	113,825,187.85	100.00	407,126,720.19	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
招商证券股份有限公司	83,240.86	100.00	41,071.47	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
招商证券股份有限公司	297,733.10	100.00	137,692.07	100.00

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	174,742.00	286,657.04
其中：支付销售机构的客户维护费	8,282.65	12,959.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.30%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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	46,597.90	76,441.89

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.08%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
招商证券	3,229,554.00	5.34	3,416,528.00	3.40

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	5,091,457.55	30,910.67	5,205,610.02	51,246.20

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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股）			
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	22.20	236	2,539.36	5,239.20	-
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	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新发流通受限	13.11	24.48	182	2,386.02	4,455.36	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新发流通受限	4.31	13.11	661	2,848.91	8,665.71	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新发流通受限	12.25	53.71	229	2,805.25	12,299.59	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新发流通受限	12.76	43.38	191	2,437.16	8,285.58	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新发流通受限	8.67	27.42	267	2,314.00	7,321.14	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新发流通受限	11.72	27.08	204	2,390.88	5,524.32	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	12.85	25.80	212	2,724.20	5,469.60	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	47.33	251.96	70	3,313.10	17,637.20	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新发流通受限	8.24	31.54	261	2,150.64	8,231.94	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新发流通受限	4.54	11.54	440	1,997.60	5,077.60	-
300971	博亚精	2021 年	2021 年	新发流	18.24	28.29	188	3,429.12	5,318.52	-

	工	4月7日	10月15日	通受限						
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新发流通受限	7.19	12.65	373	2,681.87	4,718.45	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新发流通受限	28.28	115.71	72	2,036.16	8,331.12	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新发流通受限	5.48	13.03	374	2,049.52	4,873.22	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新发流通受限	33.22	87.50	111	3,687.42	9,712.50	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新发流通受限	24.90	24.81	101	2,514.90	2,505.81	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新发流通受限	14.79	30.57	121	1,789.59	3,698.97	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新发流通受限	12.10	19.29	231	2,795.10	4,455.99	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新发流通受限	20.81	42.23	145	3,017.45	6,123.35	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新发流通受限	12.54	27.89	237	2,971.98	6,609.93	-

301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新发流通受限	8.72	27.11	418	3,644.96	11,331.98	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新发流通受限	13.75	32.98	187	2,571.25	6,167.26	-
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

注：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发行的

证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,091,457.55	-	-	-	5,091,457.55
结算备付金	139,341.11	-	-	-	139,341.11
存出保证金	88,924.47	-	-	-	88,924.47
交易性金融资产	-	-	-	107,687,735.00	107,687,735.00
应收利息	-	-	-	2,380.03	2,380.03
应收证券清算款	-	-	-	1,909,038.50	1,909,038.50
其他资产	-	-	-	81,899.70	81,899.70
资产总计	5,319,723.13	-	-	109,681,053.23	115,000,776.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	27,653.99	27,653.99
应付托管费	-	-	-	7,374.41	7,374.41
应付证券清算款	-	-	-	2,271,023.68	2,271,023.68
应付交易费用	-	-	-	41,071.47	41,071.47
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	-	-	-	2,466,426.11	2,466,426.11
利率敏感度缺口	5,319,723.13	-	-	107,214,627.12	112,534,350.25
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,091,581.41	-	-	-	3,091,581.41
结算备付金	13,828.46	-	-	-	13,828.46
存出保证金	144,580.49	-	-	-	144,580.49
交易性金融资产	-	-	-	115,826,983.40	115,826,983.40
应收证券清算款	-	-	-	12,884.41	12,884.41
应收利息	-	-	-	1,506.15	1,506.15
资产总计	3,249,990.36	-	-	115,841,373.96	119,091,364.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	189,063.12	189,063.12
应付管理人报酬	-	-	-	29,323.86	29,323.86

应付托管费	-	-	-	7,819.69	7,819.69
应付交易费用	-	-	-	37,034.30	37,034.30
其他负债	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	468,240.97	468,240.97
利率敏感度缺口	3,249,990.36	-	-	115,373,132.99	118,623,123.35

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金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	107,687,735.00	95.69	115,826,983.40	97.64
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	107,687,735.00	95.69	115,826,983.40	97.64

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2021 年 6 月 30 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	业绩比较基准上升 5%	5,460,316.78	5,789,451.87
	业绩比较基准下降 5%	-5,460,316.78	-5,789,451.87

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	107,687,735.00	93.64
	其中：股票	107,687,735.00	93.64
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	5,230,798.66	4.55
8	其他各项资产	2,082,242.70	1.81
9	合计	115,000,776.36	100.00

注：注：股票投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	89,043,954.78	79.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,799,280.13	15.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	498,120.00	0.44
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	107,341,354.91	95.39

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,796.05	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	195,627.87	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.02
F	批发和零售业	17,172.81	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,353.75	0.02
J	金融业	34,721.10	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,487.14	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	321,192.09	0.29

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：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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	24,250	12,968,900.00	11.52
2	600276	恒瑞医药	91,733	6,235,092.01	5.54
3	002415	海康威视	94,300	6,082,350.00	5.40
4	300760	迈瑞医疗	12,320	5,914,216.00	5.26
5	002594	比亚迪	18,300	4,593,300.00	4.08
6	600031	三一重工	121,800	3,540,726.00	3.15
7	603501	韦尔股份	10,600	3,413,200.00	3.03
8	300782	卓胜微	4,716	2,534,850.00	2.25
9	300014	亿纬锂能	23,003	2,390,701.79	2.12
10	002230	科大讯飞	35,373	2,390,507.34	2.12
11	300124	汇川技术	31,350	2,328,051.00	2.07
12	000661	长春高新	5,790	2,240,730.00	1.99
13	000063	中兴通讯	62,200	2,066,906.00	1.84
14	603986	兆易创新	10,864	2,041,345.60	1.81
15	300142	沃森生物	32,000	1,974,400.00	1.75
16	600196	复星医药	24,800	1,788,824.00	1.59

17	002129	中环股份	43,000	1,659,800.00	1.47
18	600570	恒生电子	17,080	1,592,710.00	1.42
19	688111	金山办公	4,000	1,579,200.00	1.40
20	601766	中国中车	249,300	1,515,744.00	1.35
21	002371	北方华创	5,000	1,386,900.00	1.23
22	600406	国电南瑞	56,760	1,319,102.40	1.17
23	002410	广联达	19,319	1,317,555.80	1.17
24	002049	紫光国微	8,300	1,279,777.00	1.14
25	300450	先导智能	20,900	1,256,926.00	1.12
26	000625	长安汽车	45,700	1,200,996.00	1.07
27	600588	用友网络	33,465	1,113,045.90	0.99
28	300454	深信服	3,956	1,026,502.88	0.91
29	300496	中科创达	6,000	942,360.00	0.84
30	300408	三环集团	22,100	937,482.00	0.83
31	002001	新 和 成	31,840	913,171.20	0.81
32	002074	国轩高科	20,900	910,404.00	0.81
33	002179	中航光电	11,076	875,225.52	0.78
34	300003	乐普医疗	25,640	823,556.80	0.73
35	002236	大华股份	37,000	780,700.00	0.69
36	000157	中联重科	84,000	776,160.00	0.69
37	002008	大族激光	17,200	694,708.00	0.62
38	300316	晶盛机电	13,256	669,428.00	0.59
39	002555	三七互娱	26,500	636,530.00	0.57
40	603160	汇顶科技	4,600	596,298.00	0.53
41	300037	新宙邦	5,900	590,590.00	0.52
42	688008	澜起科技	9,300	580,134.00	0.52
43	002624	完美世界	23,500	561,885.00	0.50
44	002405	四维图新	37,500	551,250.00	0.49
45	601360	三六零	43,900	536,019.00	0.48
46	002414	高德红外	19,100	526,778.00	0.47
47	300676	华大基因	4,200	498,120.00	0.44
48	000547	航天发展	26,200	494,394.00	0.44
49	002602	世纪华通	75,163	482,546.46	0.43
50	002212	天融信	24,400	482,388.00	0.43
51	300699	光威复材	6,348	482,130.60	0.43
52	603444	吉比特	900	477,000.00	0.42
53	002920	德赛西威	4,300	473,344.00	0.42
54	000733	振华科技	7,500	458,025.00	0.41
55	300628	亿联网络	5,450	456,710.00	0.41
56	688363	华熙生物	1,600	444,576.00	0.40
57	002439	启明星辰	15,000	435,150.00	0.39
58	002180	纳思达	13,273	427,390.60	0.38

59	002030	达安基因	19,978	424,332.72	0.38
60	002250	联化科技	15,000	418,500.00	0.37
61	688002	睿创微纳	4,000	399,320.00	0.35
62	002013	中航机电	39,200	394,744.00	0.35
63	002028	思源电气	12,500	384,875.00	0.34
64	000513	丽珠集团	7,690	384,653.80	0.34
65	600521	华海药业	17,900	373,752.00	0.33
66	603392	万泰生物	1,440	373,219.20	0.33
67	002465	海格通信	37,200	351,912.00	0.31
68	002152	广电运通	25,400	330,962.00	0.29
69	600380	健康元	24,100	330,893.00	0.29
70	002558	巨人网络	24,200	321,860.00	0.29
71	002706	良信股份	13,920	313,756.80	0.28
72	688208	道通科技	3,566	310,206.34	0.28
73	002690	美亚光电	5,480	305,564.80	0.27
74	300418	昆仑万维	16,800	275,184.00	0.24
75	002382	蓝帆医疗	13,000	271,050.00	0.24
76	600372	中航电子	15,700	259,835.00	0.23
77	300315	掌趣科技	56,580	240,465.00	0.21
78	688006	杭可科技	2,800	238,000.00	0.21
79	603712	七一二	6,400	231,040.00	0.21
80	300212	易华录	8,300	223,353.00	0.20
81	002153	石基信息	8,985	211,237.35	0.19
82	002396	星网锐捷	9,400	200,690.00	0.18
83	300171	东富龙	4,900	199,185.00	0.18
84	002643	万润股份	11,000	195,580.00	0.17
85	300002	神州泰岳	39,500	191,575.00	0.17
86	603039	泛微网络	2,800	186,340.00	0.17
87	300726	宏达电子	2,600	183,274.00	0.16
88	300369	绿盟科技	11,200	178,640.00	0.16
89	300188	美亚柏科	9,500	165,300.00	0.15
90	300866	安克创新	900	150,723.00	0.13
91	601698	中国卫通	8,900	144,091.00	0.13
92	603087	甘李药业	1,300	138,554.00	0.12
93	600582	天地科技	33,900	132,210.00	0.12
94	600633	浙数文化	16,000	114,880.00	0.10
95	300607	拓斯达	3,000	104,400.00	0.09
96	300682	朗新科技	6,100	102,602.00	0.09
97	002583	海能达	18,800	94,752.00	0.08
98	002975	博杰股份	900	79,200.00	0.07
99	300861	美畅股份	900	75,879.00	0.07
100	603786	科博达	900	67,950.00	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
2	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
3	300957	贝泰妮	70	17,637.20	0.02
4	300919	中伟股份	95	15,485.00	0.01
5	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
6	300937	药易购	229	12,299.59	0.01
7	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
8	301013	利和兴	418	11,331.98	0.01
9	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
10	300979	华利集团	111	9,712.50	0.01
11	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
12	300931	通用电梯	661	8,665.71	0.01
13	300973	立高食品	72	8,331.12	0.01
14	300940	南极光	191	8,285.58	0.01
15	300966	共同药业	261	8,231.94	0.01
16	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
17	300948	冠中生态	267	7,321.14	0.01
18	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.01
19	301009	可靠股份	237	6,609.93	0.01
20	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
21	301016	雷尔伟	187	6,167.26	0.01
22	300996	普联软件	145	6,123.35	0.01
23	300952	恒辉安防	204	5,524.32	0.00
24	300956	英力股份	212	5,469.60	0.00
25	300971	博亚精工	188	5,318.52	0.00
26	300926	博俊科技	236	5,239.20	0.00
27	300967	晓鸣股份	440	5,077.60	0.00
28	300975	商络电子	374	4,873.22	0.00
29	300972	万辰生物	373	4,718.45	0.00
30	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
31	300993	玉马遮阳	231	4,455.99	0.00
32	300930	屹通新材	182	4,455.36	0.00
33	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
34	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
35	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
36	300986	志特新材	121	3,698.97	0.00
37	300985	致远新能	101	2,505.81	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	600276	恒瑞医药	6,323,753.72	5.33
2	601012	隆基股份	3,978,897.00	3.35
3	600031	三一重工	3,903,919.00	3.29
4	603501	韦尔股份	3,417,936.00	2.88
5	300142	沃森生物	2,156,132.00	1.82
6	300760	迈瑞医疗	2,132,187.00	1.80
7	002415	海康威视	2,115,392.00	1.78
8	300750	宁德时代	2,078,000.00	1.75
9	688111	金山办公	1,683,980.00	1.42
10	300782	卓胜微	1,550,792.00	1.31
11	600570	恒生电子	1,388,753.72	1.17
12	601766	中国中车	1,382,232.00	1.17
13	603986	兆易创新	1,215,630.00	1.02
14	600588	用友网络	1,181,187.00	1.00
15	600406	国电南瑞	1,172,372.00	0.99
16	688002	睿创微纳	1,058,060.37	0.89
17	002594	比亚迪	986,963.00	0.83
18	600196	复星医药	983,086.00	0.83
19	300496	中科创达	914,568.00	0.77
20	000157	中联重科	896,274.00	0.76

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	601012	隆基股份	10,751,664.61	9.06
2	600276	恒瑞医药	7,545,364.40	6.36
3	600031	三一重工	4,706,257.10	3.97
4	603501	韦尔股份	3,389,978.00	2.86
5	601766	中国中车	1,701,327.00	1.43
6	600570	恒生电子	1,673,669.50	1.41
7	601989	中国重工	1,499,486.32	1.26
8	600406	国电南瑞	1,460,445.50	1.23
9	600588	用友网络	1,383,590.00	1.17
10	603986	兆易创新	1,294,513.40	1.09
11	600196	复星医药	1,250,886.00	1.05
12	300601	康泰生物	1,200,347.16	1.01
13	688002	睿创微纳	1,140,492.30	0.96

14	300433	蓝思科技	955,580.26	0.81
15	688008	澜起科技	882,167.99	0.74
16	300782	卓胜微	809,358.00	0.68
17	603160	汇顶科技	795,214.90	0.67
18	600066	宇通客车	741,837.51	0.63
19	601360	三六零	714,609.00	0.60
20	600536	中国软件	703,982.98	0.59

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	60,428,531.83
卖出股票收入（成交）总额	54,829,678.19

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	88,924.47
2	应收证券清算款	1,909,038.50
3	应收股利	-
4	应收利息	2,380.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	81,899.70
8	其他	-
9	合计	2,082,242.70

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300957	贝泰妮	17,637.20	0.02	新发流通受限
2	300982	苏文电能	14,356.93	0.01	新发流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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	户均持有的	持有人结构

（户）	基金份额	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（%）
2,680	22,558.82	8,838,437.00	14.62	51,619,190.00	85.38

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	招商证券股份有限公司	3,229,554.00	5.34
2	池振瑞	3000174.00	4.96
3	申万宏源证券有限公司	2253887.00	3.73
4	方正证券股份有限公司	1994396.00	3.30
5	周建珍	1600000.00	2.65
6	刘红巧	1205600.00	1.99
7	东营奥远工贸有限责任公司	1200000.00	1.98
8	魏红兵	1000000.00	1.65
9	魏元	950000.00	1.57
10	招商证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	634600.00	1.05

注：以上信息中持有人名称及持有人份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 1 日）基金份额总额	443,457,627.00
本报告期期初基金份额总额	71,457,627.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	59,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	60,457,627.00

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

§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

2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

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、基金财产以及公募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

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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	
招商证券股份有限公司	4	113,825,187.85	100.00%	83,240.86	100.00%	-

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

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
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

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	2021-01-20
2	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 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	2021-01-20
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	2021-01-29
4	《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	2021-01-29
5	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（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	2021-01-29
6	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（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	2021-01-29
7	《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合同（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	2021-01-29
8	《银华基金管理股份有限公司旗下部	四大证券报	2021-03-29

	分基金 2020 年年度报告提示性公告》		
9	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 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	2021-03-29
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	2021-03-30
11	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（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	2021-03-30
12	《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	2021-03-30
13	《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	2021-03-30
14	《银华基金管理股份有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2021-04-07
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	2021-04-21
16	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 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	2021-04-21
17	《银华基金管理股份有限公司关于增加国信证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	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	2021-05-11
18	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站,上海证券报,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
19	《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	2021-05-17
20	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 3 号)》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-17
21	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站,上海证券报,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21

22	《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	2021-05-21
23	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 4 号)》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
24	《银华基金管理股份有限公司关于银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站,上海证券报,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-27
25	《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	2021-05-27
26	《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 5 号)》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2021-05-27

§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 银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

12.1.3《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.4《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6　银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7　基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 28 日