

# 银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 16        |
| 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.....             | 16        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 21        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 21        |
| 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.....       | 21        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>22</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 22        |
| 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..... | 22        |
| 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.....      | 22        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>23</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 23        |
| 6.2 利润表.....                                 | 24        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 25        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 26        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>45</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 45        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 45        |
| 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.....     | 46        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 47        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 51        |
| 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.....    | 52        |
| 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..... | 52        |
| 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..... | 52        |
| 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.....    | 52        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 52        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 52        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 52        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>54</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 54        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 54        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 54        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                   | 54        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>55</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>56</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 56        |
| 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.....      | 56        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 56        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 56        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 56        |
| 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.....         | 56        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 56        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 61        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>64</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 64        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 64        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>65</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 65        |
| 12.2 存放地点.....                           | 65        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 65        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 银华港股通精选股票发起式        |
| 基金主代码      | 009017              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2020 年 4 月 1 日      |
| 基金管理人      | 银华基金管理股份有限公司        |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 93,320,989.48 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金将灵活运用多种投资策略，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | <p>本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例；根据国家政治经济政策精神，确定可投资的行业范围。</p> <p>本基金为股票型基金，将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，适当进行短期的战术避险选择。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货期货需缴纳的交易保证金后，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 恒生中国企业指数收益率(使用估值汇率折算)×85%+银行人民币活期存款利率(税后)×15%   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金将投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |

## 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                                | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨文辉   | 许俊                   |
|         | 联系电话 | (010)58163000                               | 010-66594319         |
|         | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn                          | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4006783333, (010)85186558                   | 95566                |
| 传真      |      | (010)58163027                               | (010) 66594942       |
| 注册地址    |      | 广东省深圳市深南大道<br>6008 号特区报业大厦 19 层             | 北京西城区复兴门内大街 1 号      |
| 办公地址    |      | 北京市东城区东长安街 1 号<br>东方广场东方经贸城 C2 办<br>公楼 15 层 | 北京西城区复兴门内大街 1 号      |
| 邮政编码    |      | 100738                                      | 100818               |
| 法定代表人   |      | 王珠林   | 刘连舸                  |

## 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<br>址 | <a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点              | 基金管理人及基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                                    |
|--------|--------------|---|
| 注册登记机构 | 银华基金管理股份有限公司 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广<br>场东方经贸城 C2 办公楼 15 层 |

### § 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       | 5,022,260.97                |
| 本期利润          | 6,131,191.09                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0648                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.37%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 14.29%                      |
| 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      | 8,285,545.44                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0888                      |
| 期末基金资产净值      | 147,033,669.26              |
| 期末基金份额净值      | 1.5756                      |
| 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   | 57.56%                      |

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      | 1.03%    | 1.47%       | -0.57%     | 0.71%         | 1.60%  | 0.76% |
| 过去三个月      | 13.31%   | 1.57%       | -3.64%     | 0.83%         | 16.95% | 0.74% |
| 过去六个月      | 14.29%   | 2.10%       | -1.40%     | 1.12%         | 15.69% | 0.98% |
| 过去一年       | 28.56%   | 1.96%       | -0.10%     | 1.08%         | 28.66% | 0.88% |
| 自基金合同生效起至今 | 57.56%   | 1.88%       | 1.41%      | 1.10%         | 56.15% | 0.78% |

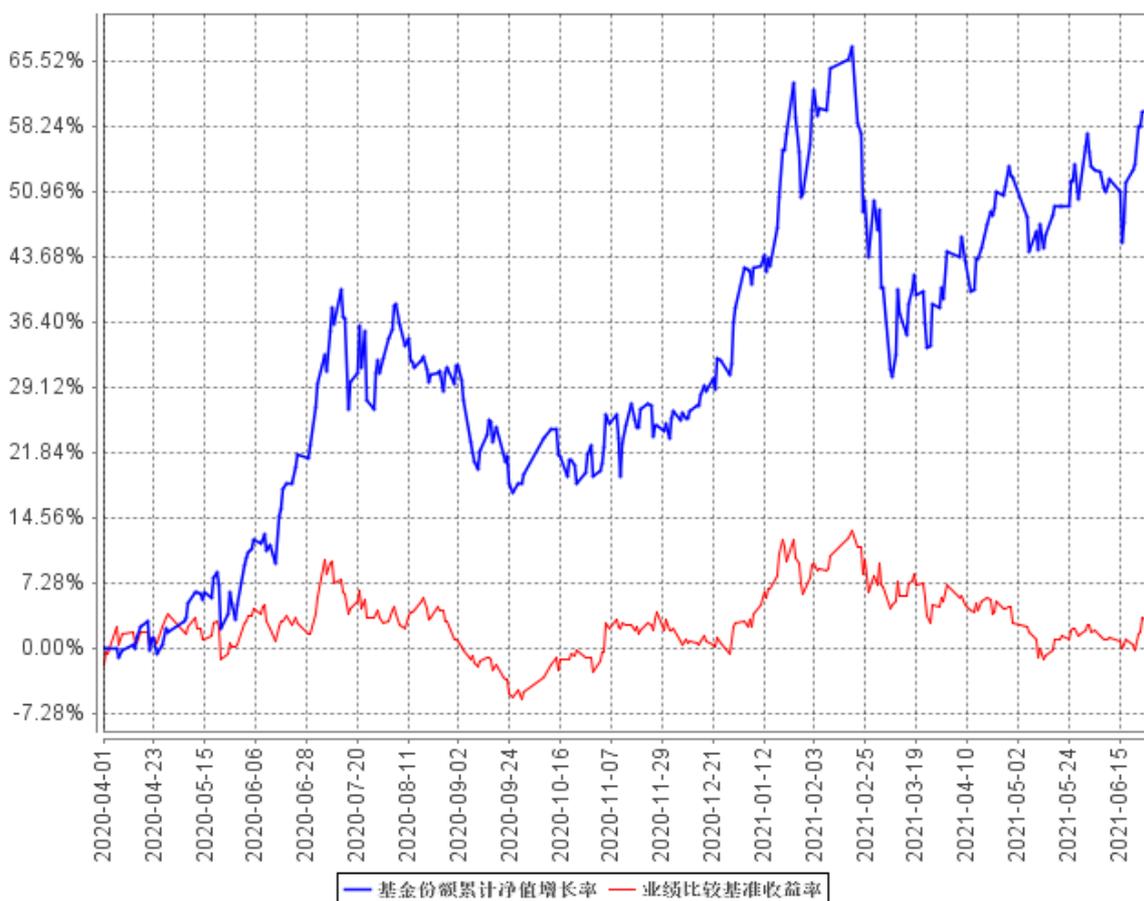
注：本基金的业绩比较基准为：恒生中国企业指数收益率(使用估值汇率折算)\*85%+银行人民币活期存款利率(税后)\*15%。

恒生中国企业指数是恒生指数有限公司编制的，反映了在香港交易所上市的 H 股中较大型股的表

现。该指数以所有在联交所上市的中国 H 股公司股票为成份股计算得出加权平均股价指数，适合作为本基金港股投资部分的业绩比较基准。本基金是股票型基金，本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，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。总之，基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 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 |        |   |
| 李晓星先生 | 本基金的基金经理 | 2020 年 4 月 1 日  | -    | 9.5 年  | 硕士学位。2006 年至 2010 年期间任职于 ABB 有限公司，历任运营发展部运营 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>顾问，集团审计部高级审计师等职务；2011年3月加盟银华基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理职务。自2015年7月7日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自2016年12月22日起兼任银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，自2017年8月11日至2020年11月20日兼任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2017年11月3日至2020年9月2日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月12日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年7月5日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年8月15日至2019年9月20日兼任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、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月16日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月1日至2021年8月18日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年4月30日起兼任银华丰享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2021年1月8日起兼任银华心佳两年持有期</p> |
|--|--|--|--|---|

|      |          |                |   |        |   |
|------|----------|----------------|---|--------|---|
|      |          |                |   |        | 混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 4 日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。   |
| 张萍女士 | 本基金的基金经理 | 2020 年 4 月 1 日 | - | 10.5 年 | 硕士学位。曾就职于中信建投证券股份有限公司，于 2015 年 8 月加入银华基金，历任行业研究员、投资经理职务，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 6 日起担任银华中小盘精选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基金经理，自 2018 年 11 月 6 日至 2020 年 9 月 2 日兼任银华估值优势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基金经理，自 2019 年 3 月 19 日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 9 月 20 日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 16 日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 1 日起兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 11 日起兼任银华品质消费股票型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 4 日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 程程先  | 本基金      | 2020 年 4 月 1 日 | - | 12.5 年 | 硕士学位。曾就职于天弘   |

|      |                |                    |   |       |   |
|------|----------------|--------------------|---|-------|---|
| 生    | 的基金<br>经理      |                    |   |       | 基金、中信证券、安永华明会计师事务所，2018 年 10 月加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自 2019 年 3 月 22 日起担任银华裕利混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2019 年 3 月 27 日起兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 16 日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 1 日起兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 11 日起兼任银华招利一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 王璐女士 | 本基金的基金<br>经理助理 | 2021 年 6 月 11<br>日 | - | 5.5 年 | 硕士学位。曾就职于九泰基金管理有限公司，2017 年 8 月加入银华基金，曾任研究部行业研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。  |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、自 2021 年 8 月 18 日起李晓星先生不再担任本基金基金经理职务。

#### 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、《银华港股通精选股票型发起式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

报告期内，港股恒指上涨 5.86%，高于同期上证综指 3.40% 涨幅，整体市场表现较好。核心资产在春节前持续上涨，节后由于流动性边际变化，引发了高估值核心资产的统一回调。从结构上看，新能源、医疗保健类涨幅较大，必选消费、科技、金融类表现不佳。市场对于长期赛道好、业绩增速快的成长行业持续给予较高溢价。

我们保持高仓位，持仓主要集中在消费+科技两大领域，消费方面包括可选消费和医药，科技方面包括新能源、半导体、顺周期成长股和互联网，精选高景气行业中高增长的个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5756 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.29%，业绩比较基准收益率为-1.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

### 一、市场看法：

在去年底我们提出，今年的年度策略是“聚焦比较优势，回避犀牛风险”。我国的比较优势是消费和科技，最大的消费市场会诞生最大的消费公司，最多的工程师红利会诞生最好的科技公司；而犀牛风险指的是房地产相关业务。从上半年的市场表现来说，消费里的医药和可选、科技里的新能源和半导体涨幅居前，房地产相关链条的公司表现较差。我们在上半年抓住了消费、医药和科技板块优质公司的投资机会，特别是在 2-3 月份在市场极度担心流动性和风格切换的时候大胆加仓，坚持以合理的价格买入聚焦景气度上行的朝阳行业里的优质公司，我们的基金们整体都取得了不错的收益率。

对于下半年的看法，我们对于指数的看法是总体平稳，结构性行情会显著。上半年是经济向好带来的上市公司 eps 的升力和流动性边际收紧带来的估值坠力之间的比赛。由于估值的变化带来的情绪变化一般是迅速的，所以整体市场体现了大起大落。随着情绪的平稳和对流动性的预期平稳，指数逐渐收复失地，整体市场走势符合我们去年底提出的前低后高的走势判断。市场只是把我们对今年一年的预期变化，在半年内走完。

展望下半年，经济的快速增长会面临一些挑战。从三大经济增长因素，消费、投资和出口来看：消费跟居民收入相关，并不会会有剧烈的变动，体现平稳；房地产投资和基建投资会面临一些压力，投资整体负面；随着海外产能竞争国的疫苗接种率的提升，欧美的通航逐渐恢复，我们目前没有明确的打开国门的时间，出口会面临不确定性。在经济的快速增长受到挑战的时候，货币政策跟上半年最紧张的时候相比，可能会有边际的好转。

我们认为下半年的市场驱动力量跟上半年相比，可能正好有所逆转。在下半年经济增速没有上半年快的情况下，一些行业和公司可能因为业绩的低预期而带来一些点的下跌，而流动性的合理充裕对于估值是有支撑的，整体市场情绪是稳定的。所以整体市场的走势会是平稳，不会出现上半年的大起大落，业绩可以持续维持增长的行业和公司有望迎来比较好的投资机会，结构性行情显著。对于下半年，我们的年度投资策略不变，依然会以合理的价格买入优质的公司，通过公司的业绩增长实现股价的增长。

### 二、焦点解析：

核心资产一直是市场关注的焦点，我们认为核心资产只是一个称号，是市场里的三好学生，短期景气度好，长期空间大。市场对于核心资产有个误区，认为核心资产是不变的，但如果我们仔细回溯过去几年的核心资产，其实迭代的速度并不慢。现在的核心资产跟 5 年前的核心资产是非常不同的，这个背后反映的是时代的变迁。很多符合社会发展方向的核心资产都创了新高，估

值不能说便宜，可能需要一定的时间去换空间。长期投资价值是显著的，如果这些优质公司可以维持一个 3-5 年的快速增长，那买入时点的估值并没有质地和行业空间重要，对于核心资产的去伪存真是异常重要的。

大小市值的风格切换也是另一个市场关注焦点，我们从来不会刻意区分中小市值和大市值的股票风格，只要满足景气度向上朝阳行业里的伟大公司这三个维度的公司，都会是我们关注的重点。中小股票的投资价值一直是存在的，从 0 到 1 的过程比从 1 到 10 的过程往往更令人兴奋。结合我们的规模所带来的冲击成本和挑中 0 到 1 公司的胜率，投资从 1 到 10 的公司往往能给持有人带来更令人满意的回报。结合目前的股价、估值和公司竞争力，我们认为优质赛道里的龙头公司的吸引力显著强于二三线公司。

同样的结论也可以延伸到 a 股和港股公司的吸引力之争。我们认为公司的投资价值并不取决于上市地点，而是取决于公司所处行业的发展空间、自身的竞争力以及买入时的价格。港股里面一些有自己特色的科技和消费，比如互联网、服装、医药和博彩，可以很好的提升整个组合的风险收益比。

我们并不认为市场担心的通胀风险是主要风险点，核心原因是我们国家的 cpi 很低，特别是猪价的持续走低。cpi 跟居民的生活成本相关，这个会导致货币政策的收紧，而 ppi 只是影响上游和中游的利润分配问题，不会特别影响到货币政策。只有当 cpi 升高时，我们才会真正开始担心流动性的变化。对于美股来说，我们认为 QE 的边际走弱并不会影响纳斯达克的上涨，因为这个本质是由美国的产业特点所决定的；而利率并没有太多的上升空间，这个是由美国的杠杆率决定的。

### 三、投资方向：

下半年我们依然会聚焦在消费和科技两大行业中景气度上行的子板块，消费我们看好长期受益消费升级的可选消费和大众持续提升健康需求的医疗保健板块，科技里面我们看好渗透率快速提升的电动车、低碳清洁能源的光伏风电以及同时受益于智能化硬件和国产化率提升的半导体行业。

以新能源和半导体作为主要投资方向的科技：

碳中和是一个十年以上的发展浪潮，是一个全球各国都极为重视的发展浪潮，是一个孕育着巨大投资机会的发展浪潮。碳中和范畴宽广，但要实现碳中和一个关键点是要实现能源生产和消费结构的转变。能源生产结构要向电气化和清洁化转变，就是发展光伏风电。能源消费结构要向电气化转变，就是发展电动车。能源生产端看新能源，能源消费端看电动车，这是未来十年以上的淘金方向。淘金已经开始一段时间，但还将继续。

上半年，光伏硅料价格大幅上涨，产业链环环传导，组件价格也上涨到运营商难受的地步。这是硅料产能增长赶不上需求增长导致的，背后是产业浪潮的推动。国内，虽然未来一年维度，硅料价格会落在一个中枢已经抬升的区间，但在政策和市场相互影响下，国内装机总量依然乐观。国外，高电价和低利率完全能消化这一波硅料价格上涨，装机需求影响不大。我们总体判断，国内和海外的装机会超越市场目前的预期，光伏将是板块性机会，且将持续较长时间。

电动车现在是从 1 到 100 的加速阶段，同时美国推出扶持政策助推，股价也经历了大幅上涨。下半年，产业仍将维持火热的阶段，预计数据是月月高涨。上半年，电池中游材料没有降价或涨价，量大幅增长，业绩将高增长，股价也反应了这点。但由于产能大幅扩张，中游材料下半年和明年边际弱化，电池环节会更好。另外，上游资源供给扩张相对受限，在需求推动下，价格有望继续修复。在关注现有的产业链放量的过程中，也要重视技术进步的趋势，整车重估仍在趋势中，电动车将铸就淘金时代。

5G 产业链中，我们首要看好半导体的投资机会。新冠疫情下供给端受限、以及下游常态化的积极备库引发全球“缺芯潮”，需求端在汽车电子化、高性能计算、AIoT 等爆发式增长带动下，我们正向看待半导体新一轮景气上行周期的持续性，缺芯背景下国产化替代会进一步加速。消费电子方面，受益于多媒体娱乐创新体验，以及全球主流大厂陆续发布新品，全球头戴显示器出货量将显著成长，重点关注 VR/MR 投资机会。顺周期成长方向，我们看好充分受益消费升级红利的品牌广告龙头公司。

展望未来 2-3 年，今年是港股的互联网巨头的布局之年。在反垄断的背景下，互联网巨头在业务拓展、报表业绩以及投资者的信心方面都处于阶段性的低点，横向比较下，估值处于合理的位置，当基本面发生拐点的时候，会体现出较大的超额收益。行业处在一波新周期的起点，随着 5g 硬件设备的出货加速，互联网行业将有新应用涌现以及商业模式升级。AR、VR、元宇宙等相关应用处于爆发的前夕，我们认为互联网的巨头能充分享受这波的科技创新红利。从细分赛道看，短视频、长视频、游戏等赛道中仍不乏优秀公司靠业绩的高速增长消化估值，去年疫情高基数的影响逐渐消散，业绩有望进入业绩上行期，值得重点关注。

以消费升级和医疗健康为主要投资方向的消费：

升级永远是消费的主题，涨价和出新是企业的表现形式。从整体看，下半年消费基本面相比上半年较为平淡，尤其是传统行业，在基数效应以及延迟消费等红利消失后，增速普遍回落，大  $\beta$  一般，下半年仍然会体现出比较明显的结构性行情。

在传统消费领域，上半年我们错过了一些疯狂，当然在没有看清楚前，我们宁愿少犯错，不追风。下半年我们会继续坚守业绩稳定性较好，预期相对合理，长期成长逻辑清晰的高端白酒，

回避高预期、高估值，以及增速确定性下行的行业和个股。对于上半年由于库存、基数等原因，一直在消化估值的调味品板块逐步提升关注。

在新兴消费方面，我们非常看好餐饮供应链和医美两大赛道，虽然行业还处于早期阶段，也存在一些不规范的地方，但确实解决消费者痛点，需求爆发的态势不可阻挡，虽然公司壁垒需要时间构筑，但长期在这两个方向一定会出现大市值公司。

我们继续看医药整体板块，伴随中国人口老龄化加速、消费升级逐步推进，医药行业景气度短期内不会改变。但是医药板块内部分化严重，我们需要从中挑选符合产业趋势、增长确定性高、成长空间大的优质企业。下半年，我们重点关注的细分领域是：医疗服务、医药研发外包、医美等。

医药的创新研发是国家大力推进的方向，是产业升级的趋势。我国医药企业创新研发投入不断创新高，一级市场在生物医药领域的融资额也一直在历史高位，相关的创新药/器械以及研发外包服务是我们一直看好的方向。消费升级趋势下，兼具医药和消费属性的医美行业进入快速发展期。行业需求旺盛、渗透率低；产品黏性强、使用频次高，多重因素叠加下，部分医美产品的放量是爆发式的。同样受消费升级驱动、以及国家政策鼓励下的民营医疗服务，去年受疫情影响严重，今年体现出强大的韧性，各个领域基本上都出现了引领行业发展的龙头企业，长周期角度依然是值得买入并持有的优质资产。

此外，我们会积极关注新渠道，比如直播、社区团购等，对消费品牌、消费结构、以及消费趋势带来的影响，警惕部分消费品由于新渠道打破原有竞争格局，对企业带来的阶段性压力。

回避强周期行业：

2021 年下半年整体经济增长降速，我们要选择业绩增速受影响较小的行业，同时匹配合适的估值。具体来讲，我们认为强周期股一定程度受损，因此我们会规避钢铁、煤炭、有色等行业。轻周期股以银行为代表，受基数影响，二三季度业绩增速较快。银行的净息差平稳上行，资产质量持续夯实，我们认为银行是价值股中较好的行业。保险行业可能要等待至 4 季度，观察明年的预售情况。券商行业自身经营波动性大，但 ROE 偏低，因此估值难系统性提升，但或许我们可以期待更好的资本市场改革。地产行业受限较多，但增速平稳，有一定的防御性。

四、努力将基金收益率曲线转化为持有人的收益率曲线

不可否认的是，市场经过二季度的上涨，目前很多股票的估值并不便宜，有些可能需要一些时间来消化估值。我们并不认为市场有大幅下跌的风险，但也建议投资者对于后市，适当降低投资收益率的预期。对于市场的波动，特别是持有期的产品，我们内心是比较坦然的，从长期角度讲，每一次的波动都会是一次超额的机会，我们对于我们的投资方法有信心。而且如果是持有期

的产品，我们并不担心持有人因为情绪的影响而在市场最恐慌的时刻实现亏损，这也是我们这几年逐步放弃了开放式产品对于规模的追求而专注做持有期产品的原因。把我们的收益率曲线真正转化为持有人的收益率曲线，是我们未来最大的追求！

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华港股通精选股票型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 16,254,600.53                  | 4,351,017.76                     |
| 结算备付金           |            | 156,540.82                     | 2,818,170.84                     |
| 存出保证金           |            | 23,250.99                      | 3,934.52                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 137,604,983.66                 | 64,546,135.77                    |
| 其中：股票投资         |            | 136,633,043.66                 | 63,452,271.87                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 971,940.00                     | 1,093,863.90                     |
| 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         |            | -                              | 1,116,087.19                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 19,457.69                      | 20,315.44                        |
| 应收股利            |            | 136,041.49                     | -                                |
| 应收申购款           |            | 268,262.46                     | 100,781.93                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 154,463,137.64                 | 72,956,443.45                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 1,716,351.88                   | 0.06                             |
| 应付赎回款           |            | 5,073,719.38                   | 1,802,887.34                     |
| 应付管理人报酬         |            | 186,396.22                     | 88,752.15                        |
| 应付托管费           |            | 31,066.02                      | 14,792.04                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 346,451.85                     | 57,421.13                        |
| 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  | 75,483.03      | 54,652.38     |
| 负债合计          |          | 7,429,468.38   | 2,018,505.10  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 93,320,989.48  | 51,456,958.22 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 53,712,679.78  | 19,480,980.13 |
| 所有者权益合计       |          | 147,033,669.26 | 70,937,938.35 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 154,463,137.64 | 72,956,443.45 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5756 元，基金份额总额 93,320,989.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

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<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 4 月 1 日(基<br>金合同生效日)至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|--|
| <b>一、收入</b>           |            | 8,889,601.53                             | 4,684,416.74   |
| 1.利息收入                |            | 67,037.78                                | 8,937.96   |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 46,340.72                                | 6,824.71   |
| 债券利息收入                |            | 20,697.06                                | 2,113.25   |
| 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）      |            | 7,249,567.73                             | 399,798.57   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 6,778,230.80                             | 326,529.99   |
| 基金投资收益                |            | -  | -  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -1,760.85                                | -1,319.30  |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -  | -  |
| 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   | 473,097.78                               | 74,587.88  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 1,108,930.12                             | 4,267,438.04   |
| 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   | 464,065.90                               | 8,242.17   |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 2,758,410.44                             | 191,138.52   |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 1,047,838.06                             | 68,263.14  |

|                            |            |              |              |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 174,639.63   | 11,377.18    |
| 3. 销售服务费                   |            | -            | -            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 1,458,348.03 | 92,757.98    |
| 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   | 77,584.72    | 18,740.22    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 6,131,191.09 | 4,493,278.22 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 6,131,191.09 | 4,493,278.22 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

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<br>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）                        | 51,456,958.22                         | 19,480,980.13  | 70,937,938.35   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 6,131,191.09   | 6,131,191.09    |
| 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）      | 41,864,031.26                         | 28,100,508.56  | 69,964,539.82   |
| 其中：1.基金申购款                             | 117,840,197.95                        | 63,307,368.06  | 181,147,566.01  |
| 2.基金赎回款                                | -75,976,166.69                        | -35,206,859.50 | -111,183,026.19 |
| 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）                        | 93,320,989.48                         | 53,712,679.78  | 147,033,669.26  |



资金利息折合 212.44 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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,200.02 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、内地依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他依法发行上市的股票）、存托凭证、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货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）。本基金的股票投资比例为基金资产的 80%-95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：恒生中国企业指数收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 85%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 15%。

#### 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》、《银华港股通精选股票型发起式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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 16,254,600.53          |
| 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：            | 16,254,600.53          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|    |                        |

|               | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动        |
|---------------|----------------|----------------|---------------|
| 股票            | 124,748,851.43 | 136,633,043.66 | 11,884,192.23 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场          | 993,645.75     | 971,940.00    |
|               | 银行间市场          | -              | -             |
|               | 合计             | 993,645.75     | 971,940.00    |
| 资产支持证券        | -              | -              | -             |
| 基金            | -              | -              | -             |
| 其他            | -              | -              | -             |
| 合计            | 125,742,497.18 | 137,604,983.66 | 11,862,486.48 |

#### 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<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,298.34          |
| 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  | 1,056.20          |
| 应收债券利息     | 17,094.85         |
| 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         | 8.30              |
| 合计         | 19,457.69         |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 346,451.85             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 346,451.85             |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 11,016.26              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 64,466.77              |
| 合计          | 75,483.03              |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 51,456,958.22                         | 51,456,958.22  |
| 本期申购          | 117,840,197.95                        | 117,840,197.95 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -75,976,166.69                        | -75,976,166.69 |
| - 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           | 93,320,989.48                         | 93,320,989.48  |

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 | -1,166,491.79 | 20,647,471.92 | 19,480,980.13 |
| 本期利润 | 5,022,260.97  | 1,108,930.12  | 6,131,191.09  |

|                |               |                |                |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,429,776.26  | 23,670,732.30  | 28,100,508.56  |
| 其中：基金申购款       | 9,706,685.75  | 53,600,682.31  | 63,307,368.06  |
| 基金赎回款          | -5,276,909.49 | -29,929,950.01 | -35,206,859.50 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 8,285,545.44  | 45,427,134.34  | 53,712,679.78  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 20,678.13                  |
| 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 | 23,038.44                  |
| 其他        | 2,624.15                   |
| 合计        | 46,340.72                  |

#### 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<br>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 | 6,778,230.80               |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                          |
| 合计               | 6,778,230.80               |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 356,516,854.18             |
| 减：卖出股票成本总额 | 349,738,623.38             |
| 买卖股票差价收入   | 6,778,230.80               |

**6.4.7.12.3 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****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,760.85                  |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | -1,760.85                  |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 114,315.78                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 113,705.85                 |
| 减：应收利息总额                | 2,370.78                   |
| 买卖债券差价收入                | -1,760.85                  |

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

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   | 473,097.78                      |
| 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            | 473,097.78                      |

#### 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                 | 1,108,930.12                    |
| ——股票投资                     | 1,117,148.17                    |
| ——债券投资                     | -8,218.05                       |
| ——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<br>增值税 | -                               |
| 合计                         | 1,108,930.12                    |

#### 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 | 464,065.90                      |
| 合计      | 464,065.90                      |

#### 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 | 1,458,348.03                    |
| 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        | 1,458,348.03 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>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     | 39,671.58                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 证券组合费_港股通 | 4,560.16                   |
| 银行费用      | 8,557.79                   |
| 合计        | 77,584.72                  |

#### 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 |

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”）   | 基金托管人、基金代销机构 |
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”）   | 基金管理人股东      |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业”） | 基金管理人股东      |

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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年4月1日(基金合同生效日)至2020<br>年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 西南证券  | 16,709,989.26              | 2.15%            | 3,692,546.00                                 | 64.26%           |
| 第一创业  | 9,347,974.64               | 1.20%            | -  | -                |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年4月1日(基金合同生效日)至2020<br>年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 西南证券  | 111,945.00                 | 100.00%          | 959,798.70                                   | 100.00%          |

##### 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<br>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 |
|-------|--|------------|----------|--------------|
| 西南证券  | 15,562.21                                | 2.43%      | 5,017.40 | 1.45%        |
| 第一创业  | 8,705.73                                 | 1.36%      | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年4月1日(基金合同生效日)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 |
| 西南证券  | 3,438.84                                 | 8.68%      | -        | -            |

## 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                   | 上年度可比期间                       |
|-----------------|----------------------|-------------------------------|
|                 | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,047,838.06         | 68,263.14                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 341,621.41           | 5,108.85                      |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间                       |
|----------------|----------------------|-------------------------------|
|                | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 174,639.63           | 11,377.18                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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****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**

份额单位：份

| 项目                        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年4月1日(基金合同生效日)<br>至2020年6月30日 |
|---------------------------|----------------------------|--|
| 基金合同生效日(2020年4月1日)持有的基金份额 | -                          | 10,000,200.02                                |
| 报告期初持有的基金份额               | 10,000,200.02              | 10,000,200.02                                |
| 报告期间申购/买入总份额              | -                          | -  |
| 报告期间因拆分变动份额               | -                          | -  |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额            | -                          | -  |
| 报告期末持有的基金份额               | 10,000,200.02              | 10,000,200.02                                |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例       | 10.72%                     | 36.07%                                       |

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

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

注：无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年4月1日(基金合同生效日)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   |
| 中国银行  | 16,254,600.53              | 20,678.13 | 2,407,074.36                             | 3,867.96 |

**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

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同责任，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 | 1 个月以内 | 1-3 个 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|--------|-------|----------|-------|-------|-----|----|
|-----|--------|-------|----------|-------|-------|-----|----|

|                     |               |       |              |      |      |                 |                |
|---------------------|---------------|-------|--------------|------|------|-----------------|----------------|
| 2021年6月30日          |               | 月     |              |      |      |                 |                |
| 资产                  |               |       |              |      |      |                 |                |
| 银行存款                | 16,254,600.53 | -     | -            | -    | -    | -               | 16,254,600.53  |
| 结算备付金               | 156,540.82    | -     | -            | -    | -    | -               | 156,540.82     |
| 存出保证金               | 18,484.87     | -     | -            | -    | -    | 4,766.12        | 23,250.99      |
| 交易性金融资产             | 971,940.00    | -     | -            | -    | -    | -136,633,043.66 | 137,604,983.66 |
| 应收利息                | -             | -     | -            | -    | -    | 19,457.69       | 19,457.69      |
| 应收股利                | -             | -     | -            | -    | -    | 136,041.49      | 136,041.49     |
| 应收申购款               | 9,500.00      | -     | -            | -    | -    | 258,762.46      | 268,262.46     |
| 资产总计                | 17,411,066.22 | -     | -            | -    | -    | -137,052,071.42 | 154,463,137.64 |
| 负债                  |               |       |              |      |      |                 |                |
| 应付证券清算款             | -             | -     | -            | -    | -    | 1,716,351.88    | 1,716,351.88   |
| 应付赎回款               | -             | -     | -            | -    | -    | 5,073,719.38    | 5,073,719.38   |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -            | -    | -    | 186,396.22      | 186,396.22     |
| 应付托管费               | -             | -     | -            | -    | -    | 31,066.02       | 31,066.02      |
| 应付交易费用              | -             | -     | -            | -    | -    | 346,451.85      | 346,451.85     |
| 其他负债                | -             | -     | -            | -    | -    | 75,483.03       | 75,483.03      |
| 负债总计                | -             | -     | -            | -    | -    | 7,429,468.38    | 7,429,468.38   |
| 利率敏感度缺口             | 17,411,066.22 | -     | -            | -    | -    | -129,622,603.04 | 147,033,669.26 |
| 上年度末<br>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                | 4,351,017.76  | -     | -            | -    | -    | -               | 4,351,017.76   |
| 结算备付金               | 2,818,170.84  | -     | -            | -    | -    | -               | 2,818,170.84   |
| 存出保证金               | 3,934.52      | -     | -            | -    | -    | -               | 3,934.52       |
| 交易性金融资产             | -             | -     | 1,093,863.90 | -    | -    | 63,452,271.87   | 64,546,135.77  |
| 应收证券清算款             | -             | -     | -            | -    | -    | 1,116,087.19    | 1,116,087.19   |
| 应收利息                | -             | -     | -            | -    | -    | 20,315.44       | 20,315.44      |
| 应收申购款               | -             | -     | -            | -    | -    | 100,781.93      | 100,781.93     |
| 资产总计                | 7,173,123.12  | -     | 1,093,863.90 | -    | -    | 64,689,456.43   | 72,956,443.45  |
| 负债                  |               |       |              |      |      |                 |                |
| 应付证券清算款             | -             | -     | -            | -    | -    | 0.06            | 0.06           |
| 应付赎回款               | -             | -     | -            | -    | -    | 1,802,887.34    | 1,802,887.34   |

|         |              |               |   |   |               |               |
|---------|--------------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | -            | -             | - | - | 88,752.15     | 88,752.15     |
| 应付托管费   | -            | -             | - | - | 14,792.04     | 14,792.04     |
| 应付交易费用  | -            | -             | - | - | 57,421.13     | 57,421.13     |
| 其他负债    | -            | -             | - | - | 54,652.38     | 54,652.38     |
| 负债总计    | -            | -             | - | - | 2,018,505.10  | 2,018,505.10  |
| 利率敏感度缺口 | 7,173,123.12 | -1,093,863.90 | - | - | 62,670,951.33 | 70,937,938.35 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021年6月30日 |                |                       |                |
|----------|-------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|          | 美元<br>折合人民币       | 港币<br>折合人民币    | 其他币<br>种<br>折合人<br>民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产 | -                 | -              | -                     | -              |
| 银行存款     | -                 | -              | -                     | -              |
| 交易性金融资产  | -                 | 134,035,710.81 | -                     | 134,035,710.81 |
| 资产合计     | -                 | 134,035,710.81 | -                     | 134,035,710.81 |
| 以外币计价的负债 | -                 | -              | -                     | -              |
| 负债合计     | -                 | -              | -                     | -              |

|               |   |                |   |                |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 134,035,710.81 | - | 134,035,710.81 |
|---------------|---|----------------|---|----------------|

单位：人民币元

| 项目            | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |                       |               |
|---------------|--------------------------|---------------|-----------------------|---------------|
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币   | 其他币<br>种<br>折合人<br>民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      | -                        |               | -                     |               |
| 银行存款          | -                        | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产       | -                        | 56,630,471.22 | -                     | 56,630,471.22 |
| 资产合计          | -                        | 56,630,471.22 | -                     | 56,630,471.22 |
| 以外币计价的负债      | -                        | -             | -                     | -             |
| 负债合计          | -                        | -             | -                     | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                        | 56,630,471.22 | -                     | 56,630,471.22 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                                |                             |                        |
|----|--------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变       |                             |                        |
|    | 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动 |                             |                        |
| 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） |
|    | 港币 5%                          | 6,701,785.54                | 2,831,523.56           |
|    | 港币-5%                          | -6,701,785.54               | -2,831,523.56          |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资

于上市交易的证券，所面临的其他价格风险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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年6月30日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                       |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 136,633,043.66    | 92.93                    | 63,452,271.87       | 89.45                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 971,940.00        | 0.66                     | 1,093,863.90        | 1.54                  |
| 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            | 137,604,983.66    | 93.59                    | 64,546,135.77       | 90.99                 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；<br>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；<br>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。 |                 |                   |
|----|---|-----------------|-------------------|
|    | 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 | 相关风险变量的变动   |                 |                   |
|    | 业绩比较基准上升 5%   | 9,942,689.63    | 3,831,842.02      |
|    | 业绩比较基准下降 5%   | -9,942,689.63   | -3,831,842.02     |

#### 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              | 136,633,043.66 | 88.46         |
|    | 其中：股票             | 136,633,043.66 | 88.46         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 971,940.00     | 0.63          |
|    | 其中：债券             | 971,940.00     | 0.63          |
|    | 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      | 16,411,141.35  | 10.62         |
| 8  | 其他各项资产            | 447,012.63     | 0.29          |
| 9  | 合计                | 154,463,137.64 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 2,597,332.85 | 1.77          |
| 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  | -            | -             |
| J  | 金融业              | -            | -             |
| K  | 房地产业             | -            | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -             |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -             |

|   |           |              |      |
|---|-----------|--------------|------|
| P | 教育        | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作   | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -            | -    |
| S | 综合        | -            | -    |
|   | 合计        | 2,597,332.85 | 1.77 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| A 基础材料    | 13,049,677.06  | 8.88         |
| B 消费者非必需品 | 3,314,673.89   | 2.25         |
| C 消费者常用品  | 10,130,108.04  | 6.89         |
| D 能源      | -              | -            |
| E 金融      | 7,701,732.48   | 5.24         |
| F 医疗保健    | 74,606,651.74  | 50.74        |
| G 工业      | -              | -            |
| H 信息技术    | 17,595,471.55  | 11.97        |
| I 电信服务    | -              | -            |
| J 公用事业    | 7,637,396.05   | 5.19         |
| K 房地产     | -              | -            |
| 合计        | 134,035,710.81 | 91.16        |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称   | 数量（股）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 2269 | 药明生物   | 119,500   | 14,149,395.59 | 9.62         |
| 2  | 1772 | 赣锋锂业   | 135,200   | 13,049,677.06 | 8.88         |
| 3  | 1951 | 锦欣生殖   | 588,000   | 9,589,555.58  | 6.52         |
| 4  | 3347 | 泰格医药   | 55,400    | 8,389,696.22  | 5.71         |
| 5  | 0388 | 香港交易所  | 20,000    | 7,701,732.48  | 5.24         |
| 6  | 0916 | 龙源电力   | 686,000   | 7,637,396.05  | 5.19         |
| 7  | 3888 | 金山软件   | 186,400   | 7,219,891.59  | 4.91         |
| 8  | 0700 | 腾讯控股   | 12,900    | 6,268,557.89  | 4.26         |
| 9  | 0460 | 四环医药   | 1,737,000 | 4,798,472.23  | 3.26         |
| 10 | 9926 | 康方生物—B | 92,000    | 4,795,942.70  | 3.26         |
| 11 | 6186 | 中国飞鹤   | 323,000   | 4,504,448.44  | 3.06         |
| 12 | 0168 | 青岛啤酒股份 | 60,000    | 4,173,713.28  | 2.84         |

|    |        |          |         |              |      |
|----|--------|----------|---------|--------------|------|
| 13 | 2096   | 先声药业     | 357,000 | 4,152,794.79 | 2.82 |
| 14 | 9966   | 康宁杰瑞制药-B | 200,000 | 4,135,437.60 | 2.81 |
| 15 | 2359   | 药明康德     | 26,500  | 3,997,686.76 | 2.72 |
| 16 | 1530   | 三生制药     | 481,000 | 3,842,212.61 | 2.61 |
| 17 | 6185   | 康希诺生物-B  | 9,800   | 3,364,498.84 | 2.29 |
| 18 | 0839   | 中教控股     | 230,000 | 3,314,673.89 | 2.25 |
| 19 | 6078   | 海吉亚医疗    | 38,400  | 3,259,090.94 | 2.22 |
| 20 | 6618   | 京东健康     | 34,350  | 3,181,170.81 | 2.16 |
| 21 | 6855   | 亚盛医药-B   | 80,500  | 3,148,174.68 | 2.14 |
| 22 | 1810   | 小米集团-W   | 94,000  | 2,111,819.04 | 1.44 |
| 23 | 0268   | 金蝶国际     | 91,000  | 1,995,203.03 | 1.36 |
| 24 | 605499 | 东鹏饮料     | 6,600   | 1,655,280.00 | 1.13 |
| 25 | 9996   | 沛嘉医疗-B   | 50,000  | 1,503,984.60 | 1.02 |
| 26 | 9633   | 农夫山泉     | 44,800  | 1,451,946.32 | 0.99 |
| 27 | 1515   | 华润医疗     | 180,000 | 1,412,372.59 | 0.96 |
| 28 | 300122 | 智飞生物     | 5,045   | 942,052.85   | 0.64 |
| 29 | 6127   | 昭衍新药     | 8,520   | 886,165.20   | 0.60 |

## 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  | 3888   | 金山软件   | 23,167,716.86 | 32.66           |
| 2  | 0388   | 香港交易所  | 22,933,908.15 | 32.33           |
| 3  | 300122 | 智飞生物   | 22,838,382.11 | 32.19           |
| 4  | 1772   | 赣锋锂业   | 17,537,787.14 | 24.72           |
| 5  | 0700   | 腾讯控股   | 13,095,624.09 | 18.46           |
| 6  | 1951   | 锦欣生殖   | 12,862,141.44 | 18.13           |
| 7  | 0268   | 金蝶国际   | 12,191,592.51 | 17.19           |
| 8  | 2359   | 药明康德   | 11,741,740.34 | 16.55           |
| 9  | 6855   | 亚盛医药-B | 11,596,388.29 | 16.35           |
| 10 | 6186   | 中国飞鹤   | 11,420,916.70 | 16.10           |

|    |        |             |               |       |
|----|--------|-------------|---------------|-------|
| 11 | 0460   | 四环医药        | 10,827,069.46 | 15.26 |
| 12 | 3759   | 康龙化成        | 10,424,774.75 | 14.70 |
| 13 | 0853   | 微创医疗        | 9,933,098.05  | 14.00 |
| 14 | 2269   | 药明生物        | 9,926,921.05  | 13.99 |
| 15 | 9926   | 康方生物—B      | 9,764,231.10  | 13.76 |
| 16 | 0981   | 中芯国际        | 9,411,906.00  | 13.27 |
| 17 | 0839   | 中教控股        | 8,424,872.82  | 11.88 |
| 18 | 3347   | 泰格医药        | 7,897,550.10  | 11.13 |
| 19 | 3690   | 美团—W        | 7,473,450.51  | 10.54 |
| 20 | 2899   | 紫金矿业        | 7,160,082.10  | 10.09 |
| 21 | 6185   | 康希诺生物—B     | 6,740,230.96  | 9.50  |
| 22 | 6618   | 京东健康        | 6,495,904.65  | 9.16  |
| 23 | 6127   | 昭衍新药        | 6,371,910.58  | 8.98  |
| 24 | 0916   | 龙源电力        | 6,270,824.19  | 8.84  |
| 25 | 300725 | 药石科技        | 5,148,209.00  | 7.26  |
| 26 | 1177   | 中国生物制药      | 4,840,159.93  | 6.82  |
| 27 | 0667   | 中国东方教育      | 4,798,052.55  | 6.76  |
| 28 | 1347   | 华虹半导体       | 4,676,143.66  | 6.59  |
| 29 | 1810   | 小米集团—W      | 4,613,341.19  | 6.50  |
| 30 | 0522   | ASM PACIFIC | 4,558,937.42  | 6.43  |
| 31 | 0027   | 银河娱乐        | 4,518,301.36  | 6.37  |
| 32 | 300896 | 爱美客         | 4,363,360.80  | 6.15  |
| 33 | 1530   | 三生制药        | 4,325,258.75  | 6.10  |
| 34 | 9922   | 九毛九         | 4,240,736.99  | 5.98  |
| 35 | 6078   | 海吉亚医疗       | 4,235,186.43  | 5.97  |
| 36 | 0168   | 青岛啤酒股份      | 4,225,644.25  | 5.96  |
| 37 | 9996   | 沛嘉医疗—B      | 4,076,810.88  | 5.75  |
| 38 | 0291   | 华润啤酒        | 4,072,150.85  | 5.74  |
| 39 | 2601   | 中国太保        | 4,021,742.53  | 5.67  |
| 40 | 1117   | 现代牧业        | 3,869,098.84  | 5.45  |
| 41 | 600276 | 恒瑞医药        | 3,784,232.60  | 5.33  |
| 42 | 2096   | 先声药业        | 3,769,933.61  | 5.31  |
| 43 | 1877   | 君实生物        | 3,706,063.10  | 5.22  |
| 44 | 1521   | 方达控股        | 3,618,184.82  | 5.10  |
| 45 | 1999   | 敏华控股        | 3,478,743.50  | 4.90  |
| 46 | 688575 | 亚辉龙         | 3,355,158.52  | 4.73  |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 47 | 9966   | 康宁杰瑞制药—B | 3,337,805.60 | 4.71 |
| 48 | 1833   | 平安好医生    | 3,331,303.01 | 4.70 |
| 49 | 688029 | 南微医学     | 3,017,760.25 | 4.25 |
| 50 | 600827 | 百联股份     | 2,904,160.00 | 4.09 |
| 51 | 600763 | 通策医疗     | 2,786,925.00 | 3.93 |
| 52 | 0241   | 阿里健康     | 2,744,594.66 | 3.87 |
| 53 | 603520 | 司太立      | 2,586,570.00 | 3.65 |
| 54 | 300573 | 兴齐眼药     | 2,400,308.24 | 3.38 |
| 55 | 000516 | 国际医学     | 2,325,884.00 | 3.28 |
| 56 | 300601 | 康泰生物     | 2,248,483.00 | 3.17 |
| 57 | 600521 | 华海药业     | 1,982,385.00 | 2.79 |
| 58 | 688613 | 奥精医疗     | 1,683,175.68 | 2.37 |
| 59 | 300676 | 华大基因     | 1,680,701.95 | 2.37 |
| 60 | 9633   | 农夫山泉     | 1,633,020.34 | 2.30 |
| 61 | 300595 | 欧普康视     | 1,621,091.00 | 2.29 |
| 62 | 300280 | 紫天科技     | 1,611,444.00 | 2.27 |
| 63 | 300015 | 爱尔眼科     | 1,610,681.00 | 2.27 |
| 64 | 002044 | 美年健康     | 1,546,795.00 | 2.18 |
| 65 | 603456 | 九洲药业     | 1,526,154.00 | 2.15 |
| 66 | 605499 | 东鹏饮料     | 1,520,776.00 | 2.14 |
| 67 | 2500   | 启明医疗—B   | 1,495,176.81 | 2.11 |
| 68 | 1515   | 华润医疗     | 1,467,068.30 | 2.07 |

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  | 300122 | 智飞生物  | 22,311,101.72 | 31.45          |
| 2  | 3888   | 金山软件  | 21,206,710.96 | 29.89          |
| 3  | 0388   | 香港交易所 | 18,368,325.44 | 25.89          |
| 4  | 3759   | 康龙化成  | 12,311,842.80 | 17.36          |
| 5  | 0700   | 腾讯控股  | 12,024,747.40 | 16.95          |
| 6  | 6186   | 中国飞鹤  | 10,561,545.79 | 14.89          |
| 7  | 1772   | 赣锋锂业  | 9,465,213.71  | 13.34          |
| 8  | 2359   | 药明康德  | 9,206,783.68  | 12.98          |
| 9  | 0981   | 中芯国际  | 8,441,611.43  | 11.90          |

|    |        |             |              |       |
|----|--------|-------------|--------------|-------|
| 10 | 0460   | 四环医药        | 8,376,187.70 | 11.81 |
| 11 | 3690   | 美团-W        | 8,209,311.21 | 11.57 |
| 12 | 0853   | 微创医疗        | 7,881,264.32 | 11.11 |
| 13 | 0268   | 金蝶国际        | 7,878,588.14 | 11.11 |
| 14 | 2899   | 紫金矿业        | 7,731,277.37 | 10.90 |
| 15 | 0291   | 华润啤酒        | 7,324,812.48 | 10.33 |
| 16 | 0667   | 中国东方教育      | 7,114,026.95 | 10.03 |
| 17 | 6855   | 亚盛医药-B      | 6,910,915.68 | 9.74  |
| 18 | 9922   | 九毛九         | 6,519,719.14 | 9.19  |
| 19 | 0839   | 中教控股        | 6,294,918.56 | 8.87  |
| 20 | 300725 | 药石科技        | 5,830,216.46 | 8.22  |
| 21 | 6127   | 昭衍新药        | 5,768,747.06 | 8.13  |
| 22 | 9926   | 康方生物-B      | 5,562,975.24 | 7.84  |
| 23 | 1810   | 小米集团-W      | 5,462,153.41 | 7.70  |
| 24 | 0027   | 银河娱乐        | 5,219,208.95 | 7.36  |
| 25 | 1951   | 锦欣生殖        | 4,842,703.36 | 6.83  |
| 26 | 2601   | 中国太保        | 4,832,472.14 | 6.81  |
| 27 | 1177   | 中国生物制药      | 4,480,587.19 | 6.32  |
| 28 | 300896 | 爱美客         | 4,405,358.81 | 6.21  |
| 29 | 0522   | ASM PACIFIC | 4,207,792.61 | 5.93  |
| 30 | 1347   | 华虹半导体       | 4,149,746.35 | 5.85  |
| 31 | 1999   | 敏华控股        | 4,054,830.77 | 5.72  |
| 32 | 6185   | 康希诺生物-B     | 3,986,509.53 | 5.62  |
| 33 | 1521   | 方达控股        | 3,924,734.58 | 5.53  |
| 34 | 1833   | 平安好医生       | 3,842,126.59 | 5.42  |
| 35 | 600276 | 恒瑞医药        | 3,765,569.30 | 5.31  |
| 36 | 688029 | 南微医学        | 3,344,554.16 | 4.71  |
| 37 | 1877   | 君实生物        | 3,304,147.49 | 4.66  |
| 38 | 600519 | 贵州茅台        | 3,252,829.05 | 4.59  |
| 39 | 1117   | 现代牧业        | 3,199,132.21 | 4.51  |
| 40 | 600763 | 通策医疗        | 3,074,045.20 | 4.33  |
| 41 | 2382   | 舜宇光学科技      | 3,050,395.32 | 4.30  |
| 42 | 603520 | 司太立         | 3,009,668.77 | 4.24  |
| 43 | 600827 | 百联股份        | 2,986,019.53 | 4.21  |
| 44 | 000516 | 国际医学        | 2,880,333.24 | 4.06  |
| 45 | 300573 | 兴齐眼药        | 2,760,179.00 | 3.89  |
| 46 | 0285   | 比亚迪电子       | 2,621,627.02 | 3.70  |
| 47 | 0241   | 阿里健康        | 2,584,695.13 | 3.64  |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 48 | 688575 | 亚辉龙    | 2,548,162.60 | 3.59 |
| 49 | 000858 | 五粮液    | 2,368,016.60 | 3.34 |
| 50 | 2319   | 蒙牛乳业   | 2,340,320.15 | 3.30 |
| 51 | 9996   | 沛嘉医疗-B | 2,336,725.34 | 3.29 |
| 52 | 2269   | 药明生物   | 2,332,495.36 | 3.29 |
| 53 | 6618   | 京东健康   | 2,329,724.99 | 3.28 |
| 54 | 300601 | 康泰生物   | 2,191,229.00 | 3.09 |
| 55 | 6862   | 海底捞    | 2,144,576.79 | 3.02 |
| 56 | 600521 | 华海药业   | 2,087,071.00 | 2.94 |
| 57 | 1579   | 颐海国际   | 1,745,816.29 | 2.46 |
| 58 | 300676 | 华大基因   | 1,704,236.00 | 2.40 |
| 59 | 300280 | 紫天科技   | 1,696,055.53 | 2.39 |
| 60 | 2318   | 中国平安   | 1,678,942.08 | 2.37 |
| 61 | 000650 | 仁和药业   | 1,650,619.00 | 2.33 |
| 62 | 300595 | 欧普康视   | 1,634,791.85 | 2.30 |
| 63 | 603456 | 九洲药业   | 1,581,104.02 | 2.23 |
| 64 | 3347   | 泰格医药   | 1,550,940.42 | 2.19 |
| 65 | 300015 | 爱尔眼科   | 1,542,427.00 | 2.17 |
| 66 | 002044 | 美年健康   | 1,531,706.20 | 2.16 |
| 67 | 688613 | 奥精医疗   | 1,447,612.51 | 2.04 |
| 68 | 2500   | 启明医疗-B | 1,445,188.10 | 2.04 |

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 | 421,802,247.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 356,516,854.18 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 971,940.00 | 0.66         |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 4  | 企业债券      | -          | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -            |

|    |           |            |      |
|----|-----------|------------|------|
| 6  | 中期票据      | -          | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -          | -    |
| 8  | 同业存单      | -          | -    |
| 9  | 其他        | -          | -    |
| 10 | 合计        | 971,940.00 | 0.66 |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张） | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 010107 | 21 国债(7) | 9,700 | 971,940.00 | 0.66         |

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

## 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：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   | 23,250.99 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利  | 136,041.49 |
| 4 | 应收利息  | 19,457.69  |
| 5 | 应收申购款 | 268,262.46 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 447,012.63 |

#### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |               |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者         |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 10,444       | 8,935.37      | 12,512,834.48 | 13.41%     | 80,808,155.00 | 86.59%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 3,521,340.39 | 3.77%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 50~100            |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有<br>资金   | 10,000,200.02 | 10.72                   | 10,000,200.02 | 10.72                   | 3年             |
| 基金管理人高级<br>管理人员 | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 基金经理等人员         | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 基金管理人股东         | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 其他              | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 合计              | 10,000,200.02 | 10.72                   | 10,000,200.02 | 10.72                   | 3年             |

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,000,200.02 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 200.02 份。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020年4月1日）基金份额总额 | 13,669,937.44  |
| 本报告期期初基金份额总额             | 51,456,958.22  |
| 本报告期基金总申购份额              | 117,840,197.95 |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 75,976,166.69  |
| 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             | 93,320,989.48  |

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

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 15 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 15 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 |    |
| 北京高华证券有限责任公司 | 3      | 618,617,701.43 | 79.48%       | 494,893.35 | 77.29%     | -  |
| 国金证券股份有限公司   | 2      | 44,685,161.58  | 5.74%        | 41,615.38  | 6.50%      | -  |
| 大同证券有限责任公司   | 1      | 32,358,896.21  | 4.16%        | 30,135.90  | 4.71%      | -  |
| 恒泰证券股份有限公司   | 1      | 22,529,441.74  | 2.89%        | 20,981.72  | 3.28%      | -  |

|              |   |               |       |           |       |            |
|--------------|---|---------------|-------|-----------|-------|------------|
| 西南证券股份有限公司   | 2 | 16,709,989.26 | 2.15% | 15,562.21 | 2.43% | -          |
| 新时代证券股份有限公司  | 2 | 16,462,080.32 | 2.12% | 12,038.81 | 1.88% | -          |
| 中信证券股份有限公司   | 4 | 14,028,761.23 | 1.80% | 13,065.13 | 2.04% | 新增 1 个交易单元 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | 9,347,974.64  | 1.20% | 8,705.73  | 1.36% | -          |
| 申万宏源证券有限公司   | 2 | 2,430,834.77  | 0.31% | 2,263.89  | 0.35% | -          |
| 国信证券股份有限公司   | 2 | 1,148,260.00  | 0.15% | 1,069.33  | 0.17% | -          |
| 国盛证券有限责任公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 国元证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 国开证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 华西证券股份有限公司   | 3 | -             | -     | -         | -     | 新增 2 个交易单元 |
| 华鑫证券有限责任公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 平安证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 山西证券股份有限公司   | 2 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 西部证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 信达证券股份有限公司   | 2 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 兴业证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 中国银河证券股份有限公司 | 3 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 招商证券股份有限公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |
| 中天证券有限责任公司   | 1 | -             | -     | -         | -     | -          |

|              |   |   |   |   |   |             |
|--------------|---|---|---|---|---|-------------|
| 中信建投证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | -           |
| 中银国际证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | -           |
| 太平洋证券股份有限公司  | 1 | - | - | - | - | -           |
| 国联证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 国海证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 方正证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 东北证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 川财证券有限责任公司   | 2 | - | - | - | - | -           |
| 上海华信证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | -           |
| 渤海证券股份有限公司   | 3 | - | - | - | - | -           |
| 财达证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | -           |
| 财信证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个交易日单元 |
| 粤开证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个交易日单元 |
| 中国中投证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | -           |
| 中信证券华南股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个交易日单元 |
| 财富证券有限责任公司   | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易日单元 |
| 广州证券股份有限公司   | 0 | - | - | - | - | 撤销 2 个交易日单元 |
| 华泰证券股份有限公司   | 0 | - | - | - | - | 撤销 1 个交易日单元 |
| 联讯证券股份有限公司   | 0 | - | - | - | - | 撤销 2 个交易日单元 |

|              |   |   |   |   |   |           |
|--------------|---|---|---|---|---|-----------|
| 中国中金财富证券有限公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销 2 个交易日 |
|--------------|---|---|---|---|---|-----------|

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 |
| 北京高华证券有限责任公司 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券股份有限公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 大同证券有限责任公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 恒泰证券股份有限公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西南证券股份有限公司   | 111,945.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 新时代证券股份有限公司  | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券股份有限公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 第一创业证券股份有限公司 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源证券有限公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券股份有限公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国盛证券有限责任公司   | -          | -            | -      | -              | -    | -            |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国开证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券有限责任公司   | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券有限责任公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司  | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股        | - | - | - | - | - | - |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 份有限公司                |   |   |   |   |   |   |
| 川财证券有<br>限责任公司       | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证<br>券有限责任<br>公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 财信证券有<br>限责任公司       | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证<br>券有限责任<br>公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券华<br>南股份有限<br>公司 | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券有<br>限责任公司       | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券股<br>份有限公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财<br>富证券有限<br>公司 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                         | 法定披露日期     |
|----|--|--------------------------------|------------|
| 1  | 《银华基金管理股份有限公司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15日 |
| 2  | 《银华港股通精选股票型发起式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年1月15日 |
| 3  | 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要》          | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电             | 2021年1月15日 |

|    |   |                                      |            |
|----|---|--------------------------------------|------------|
|    | (更新))   | 子披露网站                                |            |
| 4  | 《银华港股通精选股票型发起式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年1月15日 |
| 5  | 《银华港股通精选股票型发起式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年1月15日 |
| 6  | 《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 |
| 7  | 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金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年1月20日 |
| 8  | 《银华基金管理股份有限公司关于银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增加山西证券股份有限公司为代销机构的公告》     | 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年1月21日 |
| 9  | 《银华基金管理股份有限公司关于增加度小满基金销售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2月3日  |
| 10 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》 | 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2月5日  |
| 11 | 《银华基金管理股份有限公司关于增加北京创金启富基金销售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, 上海证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年2月23日 |
| 12 | 《银华基金管理股份有限公司关于银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增加大同证券有限责任公司为代销机构的公告》     | 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年2月25日 |
| 13 | 《银华港股通精选股票型发起式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年3月23日 |
| 14 | 《银华港股通精选股票型发起式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年3月23日 |
| 15 | 《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 |
| 16 | 《银华港股通精选股票型发起式  | 本基金管理人网站,                            | 2021年3月29日 |

|    |   |                              |                 |
|----|---|------------------------------|-----------------|
|    | 《证券投资基金 2020 年年度报告》   | 中国证监会基金电子披露网站                |                 |
| 17 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》         | 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 3 月 30 日 |
| 18 | 《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 |
| 19 | 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 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 年 4 月 21 日 |
| 20 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》 | 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 27 日 |
| 21 | 《银华基金管理股份有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》                  | 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 5 月 14 日 |
| 22 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》         | 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 17 日 |
| 23 | 《银华基金管理股份有限公司关于增加浙江同花顺基金销售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 6 月 4 日  |
| 24 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资（如有）业务的公告》     | 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 6 月 28 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2021/01/06-2021/01/19   | 10,000,200.02 | 0.00 | 0.00 | 10,000,200.02 | 10.72% |

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 1 月 15 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 15 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华港股通精选股票型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华港股通精选股票型发起式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住所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 28 日