
银华内需精选混合型证券投资基金

(LOF)

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 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..... | 18 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| §5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 20 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 21 |
| 6.1 资产负债表..... | 21 |
| 6.2 利润表..... | 22 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |
| 6.4 报表附注..... | 24 |
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |

| | |
|--|-----------|
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 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..... | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 46 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 49 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 49 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 49 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 49 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 50 |
| §10 重大事件揭示..... | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| §12 备查文件目录..... | 58 |
| 12.1 备查文件目录..... | 58 |
| 12.2 存放地点..... | 58 |
| 12.3 查阅方式..... | 58 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------|
| 基金名称 | 银华内需精选混合型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 银华内需精选混合（LOF） |
| 场内简称 | 银华内需 |
| 基金主代码 | 161810 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2009年7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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,043,845,762.72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 | 2009年10月16日 |

注：本基金的扩位证券简称为银华内需LOF。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过重点投资于内需增长背景下具有持续竞争力的优势企业，在控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点投资内需增长背景下具有持续竞争力的优势企业，力求实现基金资产的长期稳定增值。本基金的投资组合比例范围为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，预期风险与收益水平高于债券基金与货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------|--------------------|
| 名称 | | 银华基金管理股份有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨文辉 | 秦一楠 |
| | 联系电话 | (010)58163000 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4006783333, (010)85186558 | 95599 |

| | | |
|-------|-----------------------------------|-------------------------------|
| 传真 | (010) 58163027 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 广东省深圳市深南大道 6008号特区报业大厦19层 | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | 北京市东城区东长安街1号 东方广场东方经贸城C2办公楼15层 | 北京市西城区复兴门内大街28号 凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | 100738 | 100031 |
| 法定代表人 | 王珠林 | 谷澍 |

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 | 376,568,405.08 |
| 本期利润 | -433,558,633.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.3492 |
| 本期加权平均净值利润率 | -11.29% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.56% |
| 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 | 1,528,432,431.79 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.4642 |
| 期末基金资产净值 | 3,015,207,967.79 |
| 期末基金份额净值 | 2.889 |
| 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 | 194.90% |

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 | -2.17% | 0.96% | -1.58% | 0.64% | -0.59% | 0.32% |
| 过去三个月 | -0.24% | 1.05% | 3.00% | 0.78% | -3.24% | 0.27% |
| 过去六个月 | -12.56% | 1.48% | 0.69% | 1.05% | -13.25% | 0.43% |
| 过去一年 | -6.87% | 1.63% | 20.89% | 1.07% | -27.76% | 0.56% |
| 过去三年 | 106.36% | 1.87% | 42.38% | 1.09% | 63.98% | 0.78% |
| 自基金合同生效起至今 | 194.90% | 1.68% | 71.45% | 1.18% | 123.45% | 0.50% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本基金选择业绩比较基准的理由：

1. 公允性

本基金属于混合型基金。为公允体现基金管理人的投资管理能力，在分析本基金投资范围和资产配置比例的基础上，本基金采取复合业绩比较基准，选用市场代表性较好的沪深 300 指数收益率和上证国债指数收益率加权作为业绩比较基准。

由于本基金投资于股票等权益类资产占基金资产比例为 60%-95%，在实际投资运作中，其中间值 80%为本基金在均衡市场情况下的股票投资比例，在此基础上本基金再根据不同市场情况下各项大类资产的预期风险和收益水平对该比例进行动态调整，故本基金采取 80%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 20%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

总体而言，本基金业绩比较基准所选择的指数及其权重与本基金的投资范围和资产配置具有较好的一致性，可以比较公允地反映基金管理人的投资管理能力。

2. 易于观测性

本基金的业绩比较基准所采用的指数是在市场上公开披露的，相关的数据能够以合理的频率获取。其中，沪深 300 指数通过沪深两个证券交易所的卫星行情系统进行实时发布；上证国债指数则通过上海证券交易所的行情系统进行发布。上述两个指数都易于观察，任何投资人都可以使用公开的数据经过简单的算术运算获得比较基准，这保证了基金业绩评价的透明性。

3. 指数发布主体的权威性

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所联合编制、共同开发的中国 A 股市场指数，它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数，流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用。2005 年 9 月至今，沪深 300 指数由沪深证券交易所共同出资设立的中证指数有限公司接手管理。

上证国债指数的发布主体是上海证券交易所。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数，它的推出使我国证券市场股票、债券、基金三位一体的指数体系基本形成。上证国债指数的目的是反映我国债券市场整体变动状况，是我国债券市场价格变动的“指示器”。目前，该指数由中证指数有限公司受托管理。

由此可见，上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高权威和中立性。

4. 指数的知名度和认同程度

沪深 300 指数和上证国债指数在市场上具有较高的知名度及市场影响力，被广大投资人所认同，

并且已被越来越多的证券投资基金使用。

5. 指数的市场代表性

沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，它覆盖了沪深市场六成左右的市值，其走势与交易所主要指数相关性高，具有良好的市场代表性。

此外，该指数行业比重与沪深两市高度一致，体现出较强的行业代表性，能有效分散指数组合的行业风险。

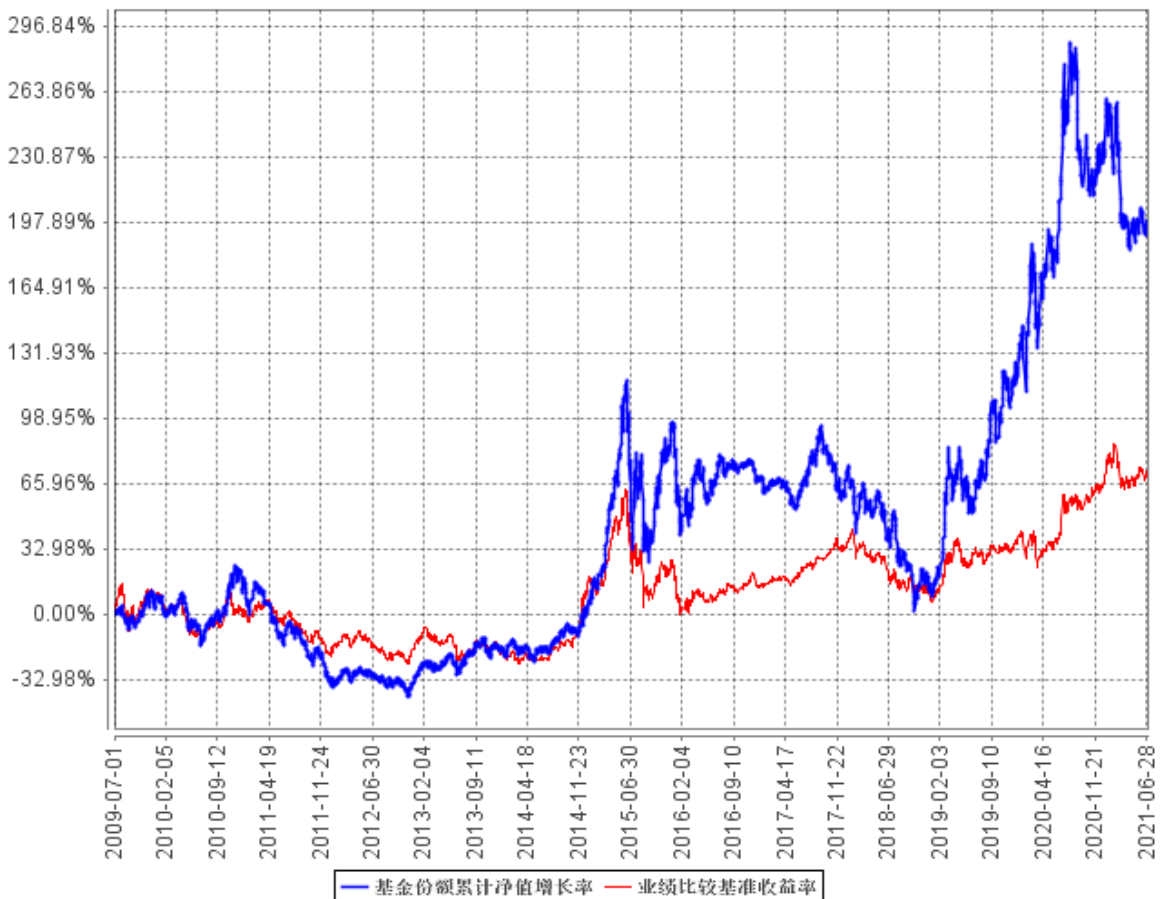
上证国债指数是目前国内涵盖范围最广的国债指数之一，具有良好的市场代表性。

6. 不可操纵性

由于本基金业绩比较基准所采用指数具有较高的市场代表性，遵循客观的编制规则，具有较强的知名度和权威性，指数的编制规则合理、科学、透明，也保证了该指数的不可操纵性。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有全部权

证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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 | | |
| 刘辉先生 | 本基金的基金 | 2017年3月15日 | - | 19.5年 | 博士学位。曾就职于中信证券股份有限公司、中信基金管理有限 |

| | | | | | |
|-------|----------|------------|---|------|--|
| | 经理 | | | | 公司、北京嘉数资产管理有限公司，从事投资研究工作。2016年11月加入银华基金管理股份有限公司，现任职于投资管理一部。自2017年3月15日担任银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自2017年3月15日至2018年3月28日兼任银华-道琼斯88精选证券投资基金基金经理，自2019年12月13日起兼任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2020年6月16日起兼任银华同力精选混合型证券投资基金基金经理，自2020年8月7日起兼任银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 王利刚先生 | 本基金的基金经理 | 2021年4月26日 | - | 8.5年 | 硕士学位。2012年7月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、投资管理一部基金经理助理，现任投资管理一部基金经理。自2019年12月31日起担任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2020年8月7日起兼任银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2021年4月26日起兼任银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）、银华同力精选混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

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、《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有

人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有1次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年的A股证券市场整体上是经历比较大的震荡之后的持续反弹上行过程。在2月比较大的下行震荡后，前期强势品种如新能源、医美等资金持续流入的方向维持了远超年初预期的强势，一直持续震荡上行，成为市场资金的重要的交易重心。

而整个市场运行的背后，是货币宽松的预期发生变化。春节后的震荡源于货币收紧的预期，而其它时间的交易活跃则源于货币宽松的真实存在。在这个过程中，市场的上涨基本上延续了优质赛道龙头公司的估值推升过程，市场交易的重心继续维持在高估值品种之上。从我们的眼光来看，上半年上涨，最为主要的推动力，还是行业景气支撑下的交易聚集所导致的估值持续推升。它体现了基本面逻辑下的趋势性投资成为市场参与的重要方式。总体来看，低估值品种的表现是明显不如高估值品种的。

我们在上半年维持了农业、科技、医药的核心配置，并适当配置了资源品作为我们低估值低位置品种。其中科技在上半年主要是下行调整态势，直到五月底出现了一些反弹回升，我们把这看作科技股自去年7月开始调整10个月以后的一次明显价格转身运动，其中属于半导体公司中的IOT的品种出现了比较明显的上涨。而农业，在5、6月猪价下行超预期的环境下，出现了一轮杀跌，并带动其它农业公司出现了程度不一的调整，同时也成为上半年亏损的主要来源。由此在市场较为强劲的剧烈震荡后的上行过程中，我们的组合大部分时间都没有在反弹的主线上，所以也未能创造明显的组合收益。

这首先涉及到年初我们对市场环境的设定上。我们设定今年可能是具有一定投资风险的震荡环境，所以在组合构建上倾向于一个静态估值低一些、具有一定防御特征的组合。但显然，上半年的市场最终体现出来的，是一个进攻型的市场，高波动性进攻资产的表现远远好于防御性资产。事实上，市场的价格运动一直在强化高波动资产的交易重心地位，防御型资产被市场阶段性冷落。

其次，在这种认知基础上，我们一度认为去年下半年的强势品种尤其是新能源方向的涨幅已经很大而且估值较高，在方向选择上对此作了系统性的低配。但事实是，上半年表现出色的品种恰恰很多是去年下半年就表现亮眼的新能源、医美、医药、白酒等品种。

以上两点，基本上表明，我们的组合总体不在今年上半年的交易主线和重心上，由此产生的收益能力自然无法让人满意。

是调整组合基本特征转向市场的当下重心，还是等待市场的变化？虽然，自5月开始的科技股反弹，给了我们组合改善的一些希望，但我们可能在基本指导思路上，还是会倾向于后者。由此，即便市场交易的重心在高估值趋势性品种之上，我们依然还是会对短期估值过高的品种进行缓步的减持，继续降低整个组合的估值水平。我们认为目前市场的上涨进入了主要由交易行为驱动的状态，而这种状态容易生变，也不是我们主要的投资视界。所以，继续耐心等待属于我们组合的机会，有可能是我们的倾向性选项。

但无论主客观原因如何，也无论后期思路如何坚持或微调，上半年组合并没有和市场的主流资金流动方向同步，并没有为持有人创造好的收益，长期处于负收益状态，为此我们需要向持有人表达我们的些许憾意和深深歉意。我们希望后续组合绩效能有所改善，以回馈长期以来众多持有人的关注。

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2.889元；本报告期基金份额净值增长率为-12.56%，业绩比较基准收益率为0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2021年下半年，我们依然保持着对于市场会出现比较明显的大的震荡的警惕。主要原因

是大量的成长赛道的品种陆续进入了非常高的静态估值状态。很高的估值状态实际上会降低品种的风险抵抗能力，一旦情绪有变，很容易发生震荡。而且，我们一直就认为，投资情绪是一个极其靠不住的东西。

同时，我们担心市场在大幅震荡以后，会出现一些明显的变化和新的资金流动线路。这些新变化，可能出现在周期性品种里，也可能出现在价值型品种里，或者其它。如果出现了这样的一些变化，总体上对我们会比当下更有利一些。但如果市场依然延续上半年的主线和行为模式，我们的组合继续承担阶段性压力也是可以预见的。

而无论市场如何发展演绎，我们还是需要有一些风险防御意识。我们会继续减持高位上涨品种，降低组合的重心和整体估值水平。

我们会继续维持农业的配置，适当增加科技股的配置，维持医药股和资源股的配置。

农业方向在当下已经有所争议，主要源于5月猪价的快速下跌。目前组合中的农业方向，包含了养殖和种植，而种植方向主要是种子方向，比重更大一些。种子方向在今年上半年一直处于调整状态，但我们认为这是一个有行业逻辑驱动的重要产业方向，行业理由我们也多次提到：生物农业介入农业生产的技术提升进程。这个过程的实际推进速度在上半年是慢于我们此前的期待，估计下半年会有所提速。而养殖品种的在经历了5、6月的行业考验以后，今年最坏的行业情况基本已经过去。预估下半年的价格会处于持续而温和的复苏中。而我们仅存的很少的个别龙头企业，其快速扩张以及成本下降过程，其实是更清晰了。

在科技方向上，我们认为科技产业链处于长时间充分调整以后的反弹之中。我们对于科技的上涨的中期以上的持续性是保持谨慎的。虽然处于反弹之中，但我们不会过分继续扩大这部分的持仓，而且会对其中一些反弹到位的品种进行减持。当然，我们会根据基本面的持续性并加上估值匹配的考虑来对品种进行甄别性的处理。

医药方向上，本基金在2021年会将医药作为一个较为重要的配置方向，但当下暂时按照维持配置来考虑。我们需要等到一个明显的板块性的调整过后，才会继续加大这部分配置。

其它有色环保证券等，作为预防性的布局配置，我们也会继续。下一阶段，我们会增加能源方向的适当配置。我们对于油价超预期上涨的可能性保持警惕，也担心由此带来的通胀预期。但我们并不能肯定这种场景的出现。所以暂时按照预防性的布局来考虑。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—银华基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，银华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 82,579,017.44 | 276,349,559.55 |
| 结算备付金 | | 2,353,466.51 | 3,469,187.10 |
| 存出保证金 | | 878,550.39 | 1,392,317.74 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,931,677,177.47 | 5,726,781,132.26 |
| 其中：股票投资 | | 2,839,842,420.57 | 5,678,682,256.96 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 91,834,756.90 | 48,098,875.30 |
| 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 | | 17,946,239.98 | 142,326,252.54 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,711,753.61 | 933,715.86 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 15,156,690.18 | 6,300,193.83 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,052,302,895.58 | 6,157,552,358.88 |
| 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 | | 1,839,979.66 | 3,031,352.56 |
| 应付赎回款 | | 28,336,179.90 | 84,429,912.60 |
| 应付管理人报酬 | | 3,834,462.63 | 7,915,110.26 |
| 应付托管费 | | 639,077.13 | 1,319,185.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,055,190.24 | 2,432,232.00 |
| 应交税费 | | 858,524.57 | 858,256.62 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 531,513.66 | 817,538.07 |
| 负债合计 | | 37,094,927.79 | 100,803,587.13 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,062,827,785.57 | 1,866,569,768.07 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,952,380,182.22 | 4,190,179,003.68 |
| 所有者权益合计 | | 3,015,207,967.79 | 6,056,748,771.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,052,302,895.58 | 6,157,552,358.88 |

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值2.889元，基金份额总额1,043,845,762.72份。

6.2 利润表

会计主体：银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021年1月1日至 2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日 |
|-------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | -392,311,680.33 | 1,204,132,242.69 |
| 1.利息收入 | | 1,772,774.14 | 932,284.70 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 508,316.95 | 928,938.05 |
| 债券利息收入 | | 1,264,457.19 | 3,346.65 |
| 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） | | 411,839,197.12 | 538,815,269.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 360,715,749.45 | 501,262,376.14 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -1,524,482.31 | 50.00 |
| 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 | 52,647,929.98 | 37,552,842.95 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -810,127,038.32 | 656,775,052.37 |
| 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 | 4,203,386.73 | 7,609,636.53 |
| 减：二、费用 | | 41,246,952.91 | 43,445,579.26 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 28,686,820.16 | 28,125,002.86 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,781,136.74 | 4,687,500.49 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 7,615,172.41 | 10,468,399.09 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 38.27 | 6.59 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 163,785.33 | 164,670.23 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -433,558,633.24 | 1,160,686,663.43 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -433,558,633.24 | 1,160,686,663.43 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
|--|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,866,569,768.07 | 4,190,179,003.68 | 6,056,748,771.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -433,558,633.24 | -433,558,633.24 |
| 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） | -803,741,982.50 | -1,804,240,188.22 | -2,607,982,170.72 |
| 其中：1.基金申购款 | 299,014,128.09 | 628,275,536.29 | 927,289,664.38 |
| 2.基金赎回款 | -1,102,756,110.59 | -2,432,515,724.51 | -3,535,271,835.10 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,062,827,785.57 | 1,952,380,182.22 | 3,015,207,967.79 |
| 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） | 1,281,578,672.87 | 1,482,105,464.91 | 2,763,684,137.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,160,686,663.43 | 1,160,686,663.43 |
| 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） | 258,442,870.62 | 509,210,805.88 | 767,653,676.50 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,326,239,467.30 | 3,633,133,092.96 | 5,959,372,560.26 |
| 2.基金赎回款 | -2,067,796,596.68 | -3,123,922,287.08 | -5,191,718,883.76 |
| 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 | 1,540,021,543.49 | 3,152,002,934.22 | 4,692,024,477.71 |

| | | | |
|--------|--|--|--|
| （基金净值） | | | |
|--------|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>王立新</u> | <u>凌宇翔</u> | <u>伍军辉</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 由天华证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 2009 年 6 月 18 日证监许可 [2009]530 号文《关于核准天华证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，天华证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)”。自 2009 年 7 月 1 日起，《银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效，原《天华证券投资基金基金合同》失效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，经协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，本基金名称由“银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)” 更名为“银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)”。

根据上述证监许可 [2009]530 号文的核准，基金管理人于 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 31 日向社会开放集中申购，首次募集规模为 4,437,014,189.20 份基金份额。

根据《银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》和《关于原天华证券投资基金基金份额折算结果的公告》的相关规定，基金管理人于 2009 年 8 月 6 日，即本基金集中申购验资完成日对投资者持有的原天华证券投资基金 (以下简称“原基金天华”) 进行了基金份额折算，折算基准日为 2009 年 8 月 5 日。基金份额折算基准日折算前基金资产净值人民币 2,376,874,407.99 元，原基金天华的基金份额按照 1:0.950749763 的折算比例进行折算，折算后基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后的基金份额总额为 2,376,874,407 份。基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提出基金份额的变更登记申请，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司已于 2009 年 8 月 6 日进行了基金份额的变更登记。

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市交易的股票、存托凭

证、债券、资产支持证券、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例范围为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1

日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转

让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 82,579,017.44 |
| 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： | 82,579,017.44 |

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 | 2,776,743,954.60 | 2,839,842,420.57 | 63,098,465.97 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 92,357,305.90 | 91,834,756.90 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 92,357,305.90 | 91,834,756.90 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,869,101,260.50 | 2,931,677,177.47 | 62,575,916.97 |

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 | 11,978.36 |
| 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 | 953.10 |
| 应收债券利息 | 1,698,453.30 |
| 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 | 13.08 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 355.77 |
| 合计 | 1,711,753.61 |

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,054,886.04 |
| 银行间市场应付交易费用 | 304.20 |
| 合计 | 1,055,190.24 |

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 | 250,000.00 |
| 应付赎回费 | 86,680.17 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 其他应付款其他 | 65,901.76 |
| 预提费用 | 128,931.73 |
| 合计 | 531,513.66 |

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 | 1,833,232,945.30 | 1,866,569,768.07 |
| 本期申购 | 293,672,770.07 | 299,014,128.09 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,083,059,952.65 | -1,102,756,110.59 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,043,845,762.72 | 1,062,827,785.57 |

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 | 2,166,139,911.52 | 2,024,039,092.16 | 4,190,179,003.68 |
| 本期利润 | 376,568,405.08 | -810,127,038.32 | -433,558,633.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,014,275,884.81 | -789,964,303.41 | -1,804,240,188.22 |
| 其中：基金申购款 | 386,332,890.92 | 241,942,645.37 | 628,275,536.29 |
| 基金赎回款 | -1,400,608,775.73 | -1,031,906,948.78 | -2,432,515,724.51 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,528,432,431.79 | 423,947,750.43 | 1,952,380,182.22 |

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 | 485,383.95 |
| 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 | 13,585.38 |
| 其他 | 9,347.62 |
| 合计 | 508,316.95 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 3,383,730,262.46 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,023,014,513.01 |
| 买卖股票差价收入 | 360,715,749.45 |

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 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 | -1,524,482.31 |
| 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 | -1,524,482.31 |

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 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 | 44,036,235.38 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 44,914,650.56 |
| 减：应收利息总额 | 646,067.13 |
| 买卖债券差价收入 | -1,524,482.31 |

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 | 52,647,929.98 |
| 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 | 52,647,929.98 |

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 | -810,127,038.32 |
| ——股票投资 | -810,526,036.00 |
| ——债券投资 | 398,997.68 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税 | - |
| 合计 | -810,127,038.32 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 4,203,386.73 |
| 合计 | 4,203,386.73 |

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 | 7,615,172.41 |
| 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 | 7,615,172.41 |

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 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 16,253.60 |
| 账户服务费 | 18,600.00 |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 合计 | 163,785.33 |

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 |
|------------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 银华基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 |
| 西南证券 | 1,310,061,839.13 | 31.30% | 4,463,763,982.64 | 61.44% |
| 第一创业 | - | - | 166,389,663.62 | 2.29% |

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 |
| 西南证券 | 1,220,058.65 | 31.62% | - | - |

| 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 |
| 西南证券 | 4,157,100.41 | 63.76% | 2,226,731.15 | 67.88% |
| 第一创业 | 154,957.18 | 2.38% | 154,957.18 | 4.72% |

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 28,686,820.16 | 28,125,002.86 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,732,547.27 | 8,025,233.37 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,781,136.74 | 4,687,500.49 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 |
| 中国农业银行 | 82,579,017.44 | 485,383.95 | 308,192,361.58 | 852,111.62 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|--------------|----------------|----------------|----|--|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 | |
| 603068 | 博通集成 | 2021年1月12日 | 2021年7月9日 | 增发流通受限 | 65.00 | 80.79 | 1,573,753 | 102,293,945.00 | 127,143,504.87 | - | |
| 603533 | 掌阅 | 2021年2月 | 2021年8月 | 增发流通 | 28.00 | 27.61 | 3,214,285 | 89,999,980.00 | 88,746,408.85 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--|----|------|--------|----|--|--|--|--|--|--|
| | 科技 | 18 日 | 月 10 日 | 受限 | | | | | | |
|--|----|------|--------|----|--|--|--|--|--|--|

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

证券，不得超过该证券的10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年6 月30日 | 1个月以内 | 1-3 个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|-----------|----------------|------|------|-------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 82,579,017.44 | - | - | - | - | - | 82,579,017.44 |
| 结算备付金 | 2,353,466.51 | - | - | - | - | - | 2,353,466.51 |
| 存出保证金 | 878,550.39 | - | - | - | - | - | 878,550.39 |
| 交易性金融资产 | 76,849,446.00 | - | -14,985,310.90 | - | - | -2,839,842,420.57 | 2,931,677,177.47 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 17,946,239.98 | 17,946,239.98 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,711,753.61 | 1,711,753.61 |
| 应收申购款 | 148,789.62 | - | - | - | - | 15,007,900.56 | 15,156,690.18 |
| 资产总计 | 162,809,269.96 | - | -14,985,310.90 | - | - | -2,874,508,314.72 | 3,052,302,895.58 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,839,979.66 | 1,839,979.66 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 28,336,179.90 | 28,336,179.90 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,834,462.63 | 3,834,462.63 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 639,077.13 | 639,077.13 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,055,190.24 | 1,055,190.24 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 858,524.57 | 858,524.57 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 531,513.66 | 531,513.66 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 37,094,927.79 | 37,094,927.79 |
| 利率敏感度缺口 | 162,809,269.96 | - | -14,985,310.90 | - | - | -2,837,413,386.93 | 3,015,207,967.79 |
| 上年度末 | 1个月以内 | 1-3 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| 2020年12月31日 | | 个月 | | | | | |
|-------------|----------------|----------------|---|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 276,349,559.55 | - | - | - | - | - | 276,349,559.55 |
| 结算备付金 | 3,469,187.10 | - | - | - | - | - | 3,469,187.10 |
| 存出保证金 | 1,392,317.74 | - | - | - | - | - | 1,392,317.74 |
| 交易性金融资产 | 22,248,774.90 | -21,164,900.40 | - | -4,685,200.00 | 5,678,682,256.96 | 5,726,781,132.26 | 6,726,781,132.26 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 142,326,252.54 | 142,326,252.54 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 933,715.86 | 933,715.86 |
| 应收申购款 | 58,093.50 | - | - | - | - | 6,242,100.33 | 6,300,193.83 |
| 资产总计 | 303,517,932.79 | -21,164,900.40 | - | -4,685,200.00 | 5,828,184,325.69 | 6,157,552,358.88 | 6,157,552,358.88 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,031,352.56 | 3,031,352.56 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 84,429,912.60 | 84,429,912.60 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 7,915,110.26 | 7,915,110.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,319,185.02 | 1,319,185.02 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,432,232.00 | 2,432,232.00 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 858,256.62 | 858,256.62 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 817,538.07 | 817,538.07 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 100,803,587.13 | 100,803,587.13 |
| 利率敏感度缺口 | 303,517,932.79 | -21,164,900.40 | - | -4,685,200.00 | 5,727,380,738.56 | 6,056,748,771.75 | 6,056,748,771.75 |

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 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 | 2,839,842,420.57 | 94.18 | 5,678,682,256.96 | 93.76 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 91,834,756.90 | 3.05 | 48,098,875.30 | 0.79 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,931,677,177.47 | 97.23 | 5,726,781,132.26 | 94.55 |

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变； 用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险； Beta系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 | | |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| | 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） | |
| 分析 | | 本期末（2021年6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升5% | 164,683,970.27 | 401,574,584.78 |
| | 业绩比较基准下降5% | -164,683,970.27 | -401,574,584.78 |

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 | 2,839,842,420.57 | 93.04 |
| | 其中：股票 | 2,839,842,420.57 | 93.04 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 91,834,756.90 | 3.01 |
| | 其中：债券 | 91,834,756.90 | 3.01 |
| | 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 | 84,932,483.95 | 2.78 |
| 8 | 其他各项资产 | 35,693,234.16 | 1.17 |
| 9 | 合计 | 3,052,302,895.58 | 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 | 639,531,000.00 | 21.21 |
| B | 采矿业 | 231,860,000.00 | 7.69 |
| C | 制造业 | 1,464,911,964.22 | 48.58 |
| 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 | 235,400,486.35 | 7.81 |
| J | 金融业 | 38,970.00 | 0.00 |
| 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 | 268,100,000.00 | 8.89 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,839,842,420.57 | 94.18 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 300244 | 迪安诊断 | 7,000,000 | 268,100,000.00 | 8.89 |
| 2 | 002157 | 正邦科技 | 22,380,000 | 267,441,000.00 | 8.87 |
| 3 | 300087 | 荃银高科 | 11,700,000 | 262,197,000.00 | 8.70 |
| 4 | 002385 | 大北农 | 38,200,000 | 259,760,000.00 | 8.61 |
| 5 | 603068 | 博通集成 | 3,160,000 | 257,691,632.97 | 8.55 |
| 6 | 603986 | 兆易创新 | 1,360,000 | 255,544,000.00 | 8.48 |
| 7 | 002299 | 圣农发展 | 10,600,000 | 253,128,000.00 | 8.40 |
| 8 | 000603 | 盛达资源 | 15,800,000 | 198,922,000.00 | 6.60 |
| 9 | 300558 | 贝达药业 | 1,430,000 | 154,783,200.00 | 5.13 |
| 10 | 300773 | 拉卡拉 | 5,000,000 | 141,150,000.00 | 4.68 |
| 11 | 300502 | 新易盛 | 3,800,001 | 118,750,031.25 | 3.94 |
| 12 | 603533 | 掌阅科技 | 3,220,000 | 88,909,286.35 | 2.95 |
| 13 | 002041 | 登海种业 | 5,000,000 | 75,550,000.00 | 2.51 |
| 14 | 002273 | 水晶光电 | 5,100,000 | 74,919,000.00 | 2.48 |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 800,000 | 48,656,000.00 | 1.61 |
| 16 | 601857 | 中国石油 | 5,000,000 | 26,450,000.00 | 0.88 |
| 17 | 688127 | 蓝特光学 | 880,000 | 24,472,800.00 | 0.81 |
| 18 | 688165 | 埃夫特 | 1,800,000 | 20,322,000.00 | 0.67 |
| 19 | 603612 | 索通发展 | 700,000 | 12,579,000.00 | 0.42 |
| 20 | 688007 | 光峰科技 | 180,000 | 7,538,400.00 | 0.25 |
| 21 | 601808 | 中海油服 | 300,000 | 4,308,000.00 | 0.14 |
| 22 | 688111 | 金山办公 | 10,000 | 3,948,000.00 | 0.13 |
| 23 | 688003 | 天准科技 | 100,000 | 3,515,000.00 | 0.12 |
| 24 | 688299 | 长阳科技 | 110,000 | 2,967,800.00 | 0.10 |
| 25 | 600028 | 中国石化 | 500,000 | 2,180,000.00 | 0.07 |
| 26 | 003021 | 兆威机电 | 30,000 | 1,832,400.00 | 0.06 |
| 27 | 300054 | 鼎龙股份 | 100,000 | 1,825,000.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 28 | 300598 | 诚迈科技 | 10,000 | 835,700.00 | 0.03 |
| 29 | 688088 | 虹软科技 | 10,000 | 557,500.00 | 0.02 |
| 30 | 600989 | 宝丰能源 | 30,000 | 410,400.00 | 0.01 |
| 31 | 603348 | 文灿股份 | 10,000 | 350,000.00 | 0.01 |
| 32 | 002124 | 天邦股份 | 30,000 | 210,300.00 | 0.01 |
| 33 | 002142 | 宁波银行 | 1,000 | 38,970.00 | 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 | 300502 | 新易盛 | 135,667,832.82 | 2.24 |
| 2 | 002714 | 牧原股份 | 130,511,652.38 | 2.15 |
| 3 | 603068 | 博通集成 | 126,590,092.00 | 2.09 |
| 4 | 002041 | 登海种业 | 100,284,835.35 | 1.66 |
| 5 | 300773 | 拉卡拉 | 97,298,867.13 | 1.61 |
| 6 | 603533 | 掌阅科技 | 90,770,197.00 | 1.50 |
| 7 | 002273 | 水晶光电 | 68,175,102.26 | 1.13 |
| 8 | 002100 | 天康生物 | 62,918,252.10 | 1.04 |
| 9 | 603986 | 兆易创新 | 51,875,176.39 | 0.86 |
| 10 | 002124 | 天邦股份 | 46,979,776.23 | 0.78 |
| 11 | 000998 | 隆平高科 | 30,520,424.20 | 0.50 |
| 12 | 603363 | 傲农生物 | 29,227,677.67 | 0.48 |
| 13 | 601857 | 中国石油 | 26,041,368.00 | 0.43 |
| 14 | 688127 | 蓝特光学 | 22,340,130.23 | 0.37 |
| 15 | 601952 | 苏垦农发 | 16,905,885.00 | 0.28 |
| 16 | 002157 | 正邦科技 | 12,016,144.00 | 0.20 |
| 17 | 603612 | 索通发展 | 11,586,706.23 | 0.19 |
| 18 | 688088 | 虹软科技 | 8,470,264.57 | 0.14 |
| 19 | 688165 | 埃夫特 | 5,905,495.83 | 0.10 |
| 20 | 600313 | 农发种业 | 5,659,991.00 | 0.09 |

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 | 002714 | 牧原股份 | 331,908,830.41 | 5.48 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 2 | 002299 | 圣农发展 | 329,987,532.00 | 5.45 |
| 3 | 688111 | 金山办公 | 328,428,570.74 | 5.42 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 274,613,841.82 | 4.53 |
| 5 | 603019 | 中科曙光 | 254,476,492.86 | 4.20 |
| 6 | 002385 | 大北农 | 250,227,304.70 | 4.13 |
| 7 | 002124 | 天邦股份 | 215,178,275.85 | 3.55 |
| 8 | 300558 | 贝达药业 | 197,365,522.17 | 3.26 |
| 9 | 002100 | 天康生物 | 194,117,343.22 | 3.20 |
| 10 | 300598 | 诚迈科技 | 176,351,656.60 | 2.91 |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 141,371,461.99 | 2.33 |
| 12 | 002157 | 正邦科技 | 138,969,224.67 | 2.29 |
| 13 | 300630 | 普利制药 | 82,230,522.70 | 1.36 |
| 14 | 002041 | 登海种业 | 70,273,853.42 | 1.16 |
| 15 | 688088 | 虹软科技 | 65,751,396.54 | 1.09 |
| 16 | 300422 | 博世科 | 54,971,169.01 | 0.91 |
| 17 | 688020 | 方邦股份 | 38,967,938.13 | 0.64 |
| 18 | 300087 | 荃银高科 | 35,809,287.10 | 0.59 |
| 19 | 000998 | 隆平高科 | 32,384,329.98 | 0.53 |
| 20 | 603363 | 傲农生物 | 28,598,040.64 | 0.47 |

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 | 994,700,712.62 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,383,730,262.46 |

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 | 91,834,756.90 | 3.05 |
| 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 | 91,834,756.90 | 3.05 |
|----|----|---------------|------|

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) | 497,230 | 49,822,446.00 | 1.65 |
| 2 | 019640 | 20 国债 10 | 270,270 | 27,027,000.00 | 0.90 |
| 3 | 019645 | 20 国债 15 | 149,390 | 14,985,310.90 | 0.50 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 878,550.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,946,239.98 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,711,753.61 |
| 5 | 应收申购款 | 15,156,690.18 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 35,693,234.16 |

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

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 | 603068 | 博通集成 | 127,143,504.87 | 4.22 | 非公开发行流通受限 |

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，各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 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 267,135 | 3,907.56 | 63,839,655.38 | 6.12% | 980,006,107.34 | 93.88% |

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 | 北京益施多科技有限公司 | 1,863,470.00 | 2.22% |
| 2 | 中国人寿保险股份有限公司 | 1,399,955.00 | 1.67% |
| 3 | 顾红 | 941,242.00 | 1.12% |
| 4 | 绿谷（集团）有限公司 | 900,089.00 | 1.07% |
| 5 | 马晓华 | 723,142.00 | 0.86% |
| 6 | 张悦萍 | 550,000.00 | 0.66% |
| 7 | 张萍 | 522,400.00 | 0.62% |
| 8 | 谢晓旻 | 504,664.00 | 0.60% |
| 9 | 中银国际证券股份有限公司 客户信用交易担保证券账户 | 477,456.00 | 0.57% |
| 10 | 河南智泰信息技术有限公司 | 472,900.00 | 0.56% |

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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 | 6,138,708.39 | 0.59% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2009年7月1日）基金份额总额 | 2,500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,833,232,945.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 293,672,770.07 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,083,059,952.65 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,043,845,762.72 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

本报告期内本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或者处罚。

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 | |
| 中国银河证券股份有限公司 | 3 | 1,766,294,344.13 | 42.19% | 1,644,952.87 | 42.63% | - |
| 西南证券股份有限公司 | 3 | 1,310,061,839.13 | 31.30% | 1,220,058.65 | 31.62% | 新增2个交易单元 |
| 申万宏源集团股份有限公司 | 2 | 622,354,356.93 | 14.87% | 579,601.02 | 15.02% | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|----------------|-------|------------|-------|----------|
| 海通证券股份有限公司 | 2 | 289,486,243.87 | 6.92% | 269,599.26 | 6.99% | - |
| 华安证券股份有限公司 | 2 | 143,407,770.05 | 3.43% | 104,873.96 | 2.72% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 54,524,077.07 | 1.30% | 39,873.94 | 1.03% | - |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增1个交易单元 |
| 中国国际金融股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | 新增2个交易单元 |
| 兴业证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增2个交易单元 |
| 中国中金财富证券有限公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销2个交易单元 |
| 汉唐证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增1个交易单元 |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增2个交易单元 |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新增1个交易单元 |
| 信达证券股份有限公司 | 0 | - | - | - | - | 撤销1个交易单元 |
| 申港证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

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

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 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 16,930,944.24 | 16.37% | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源集团股份有限公司 | 71,893,211.55 | 69.51% | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 4,536,936.32 | 4.39% | - | - | - | - |
| 华安证券股份有限公司 | 10,072,559.06 | 9.74% | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 中国国际金 融股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财 富证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 汉唐证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|---|------------|
| 1 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》 | 本基金管理人网站, 中国证券报, 上海证券报, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年1月14日 |
| 2 | 《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 |
| 3 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年1月15日 |
| 4 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2021年第1号）》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年1月15日 |
| 5 | 《银华内需精选混合型证券投资 | 本基金管理人网站, | 2021年1月15日 |

| | | | |
|----|--|--|------------|
| | 基金（LOF）基金合同（2021年1月修订）》 | 中国证监会基金电子披露网站 | |
| 6 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）托管协议（2021年1月修订）》 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年1月15日 |
| 7 | 《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 |
| 8 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）2020年第4季度报告》 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年1月20日 |
| 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持有的盛达资源估值方法调整的公告》 | 本基金管理人网站， 中国证券报，上海证券报，中国证监会基金电子披露网站 | 2021年2月19日 |
| 11 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》 | 本基金管理人网站， 上海证券报，证券日报，中国证监会基金电子披露网站 | 2021年2月22日 |
| 12 | 《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 |
| 13 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）2020年年度报告》 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年3月29日 |
| 14 | 《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 |
| 15 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）2021年第1季度报告》 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年4月21日 |
| 16 | 《银华基金管理股份有限公司关于银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）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年4月28日 |
| 17 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）》 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站 | 2021年4月28日 |
| 18 | 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书 | 本基金管理人网站， 中国证监会基金电 | 2021年4月28日 |

| | | | |
|--|----------------|-------|--|
| | （2021 年第 2 号）》 | 子披露网站 | |
|--|----------------|-------|--|

§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

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 中国证监会核准银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）设立的文件
- 12.1.2 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 12.1.3 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 12.1.4 《银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 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
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021年8月28日