银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金
2020年年度报告

2020年12月31日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2021年3月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2020年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....14
§4 管理人报告.....15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....20
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.....22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....23
4.9 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.....23
§5 托管人报告.....24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....24
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.....24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....24
§6 审计报告.....25
6.1 审计报告基本信息.....25
6.2 审计报告的基本内容.....25
§7 年度财务报表.....28
7.1 资产负债表.....28
7.2 利润表.....29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....30
7.4 报表附注.....31
§8 投资组合报告.....59
8.1 期末基金资产组合情况.....59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....79
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....79
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....79

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....79
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....79
8.12 投资组合报告附注.....79
§9 基金份额持有人信息.....81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....82
§10 开放式基金份额变动.....83
§11 重大事件揭示.....84
11.1 基金份额持有人大会决议.....84
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....84
11.4 基金投资策略的改变.....84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....84
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....84
11.8 其他重大事件.....88
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....92
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....92
§13 备查文件目录.....93
13.1 备查文件目录.....93
13.2 存放地点.....93
13.3 查阅方式.....93

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华信息科技量化股票发起式	
基金主代码	005035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年9月15日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	238,776,806.35份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C
下属分级基金的交易代码：	005035	005036
报告期末下属分级基金的份额总额	230,236,043.08份	8,540,763.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于可以代表未来信息科技发展趋势的上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资于信息科技主题，使用主动量化策略对信息科技主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪信息科技主题整体市场表现的同时，获得相对于业绩比较基准的超额收益。本基金债券投资的主要目的是风险防御及现金替代性管理。债券投资将坚持安全性、流动性和收益性作为资产配置原则，采取久期调整策略、类属配置策略、收益率曲线策略，以兼顾投资组合的安全性、收益性与流动性。本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为80%-95%；投资于信息科技主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	中信计算机指数收益率×30%＋中信通信指数收益率×30%＋中信电子元器件指数收益率×30%＋商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010)58163000	(010)66105799

	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95588
传真		(010)58163027	(010)66105798
注册地址		广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年		2019年		2018年	
	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C
本期已实现收益	1,266,417.80	2,191,297.10	2,746,822.51	1,542,553.41	-3,948,591.22	-983,236.08
本期利润	5,547,411.05	2,135,171.75	5,045,163.14	2,147,316.56	-4,127,428.07	-1,183,023.71
加权平均基金份额本期利润	0.0531	0.1888	0.2726	0.2194	-0.2894	-0.3131

本期加权平均净值利润率	4.42%	16.39%	33.92%	26.98%	-37.75%	-41.00%
本期基金份额净值增长率	33.58%	33.06%	51.59%	51.48%	-32.00%	-31.66%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	11,495,304.23	412,060.58	-3,131,820.15	-1,362,348.92	-5,848,913.37	-1,706,926.31
期	0.0499	0.0482	-0.1667	-0.1642	-0.3882	-0.3860

末可供分配基金份额利润						
期末基金资产净值	285,215,667.98	10,569,817.49	17,427,609.73	7,714,530.78	9,217,756.64	2,714,894.04
期末基金份额净值	1.2388	1.2376	0.9274	0.9301	0.6118	0.6140
3.1.3 累计期末指标	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额累	23.88%	23.76%	-7.26%	-6.99%	-38.82%	-38.60%

计净值增长率						

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

银华信息科技量化股票发起式A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.25%	1.14%	-1.70%	1.28%	5.95%	-0.14%
过去六个月	1.48%	1.53%	-4.06%	1.62%	5.54%	-0.09%
过去一年	33.58%	1.92%	12.51%	1.96%	21.07%	-0.04%
过去三年	37.69%	1.81%	13.33%	1.82%	24.36%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.88%	1.76%	8.55%	1.77%	15.33%	-0.01%

银华信息科技量化股票发起式C

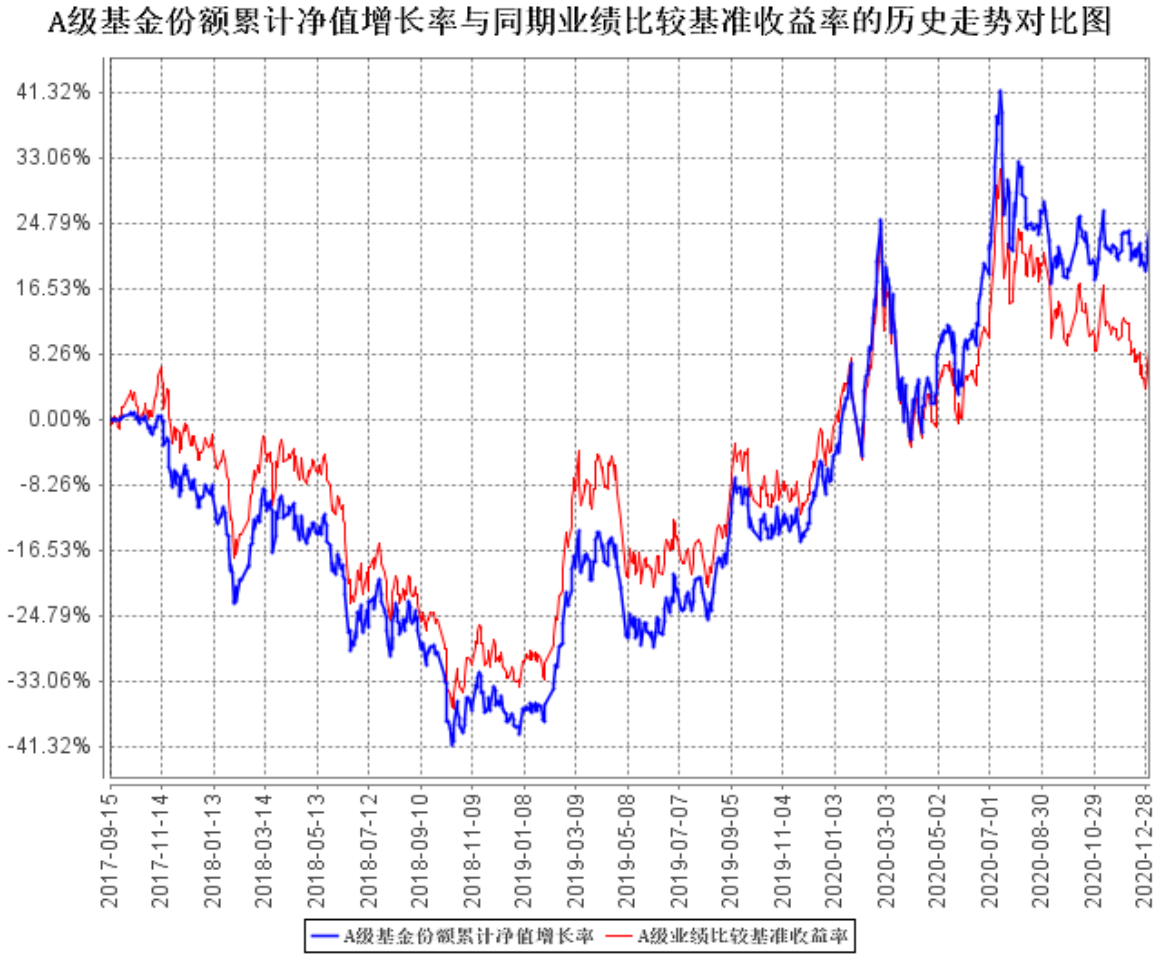
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.15%	1.14%	-1.70%	1.28%	5.85%	-0.14%
过去六个月	1.28%	1.53%	-4.06%	1.62%	5.34%	-0.09%
过去一年	33.06%	1.92%	12.51%	1.96%	20.55%	-0.04%
过去三年	37.74%	1.82%	13.33%	1.82%	24.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	23.76%	1.76%	8.55%	1.77%	15.21%	-0.01%

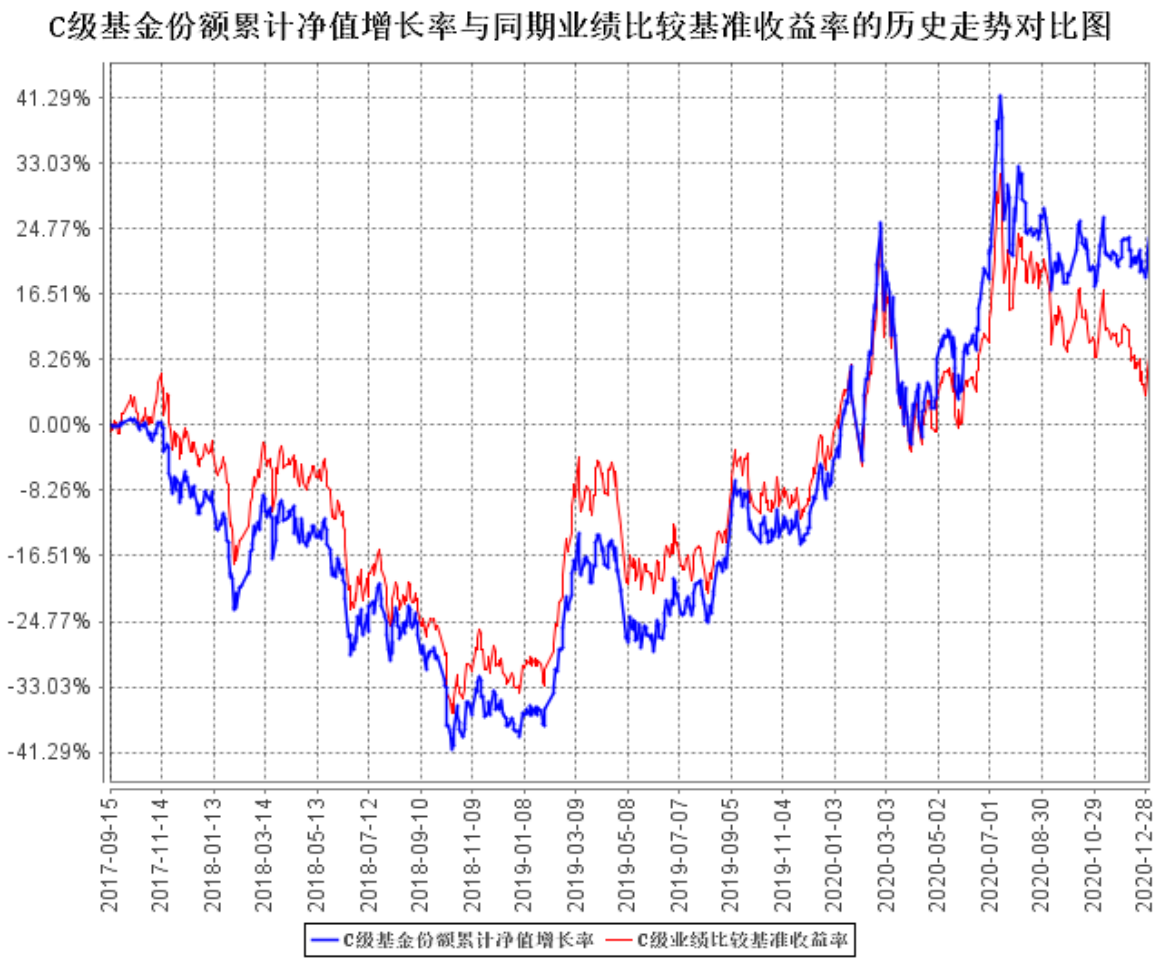
注：本基金的业绩比较基准为：中信计算机指数收益率*30%+中信通信指数收益率*30%+中信电子元器件指数收益率*30%+商业银行人民币活期存款利率(税后)*10%

本基金股票部分主要投资于信息科技主题的股票。中信计算机指数、通信指数、电子元器件指数分别反应了沪深A股中计算机行业公司、通信行业公司、电子元器件行业公司股票的整体表现，对本

基金定义的信息科技主题具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

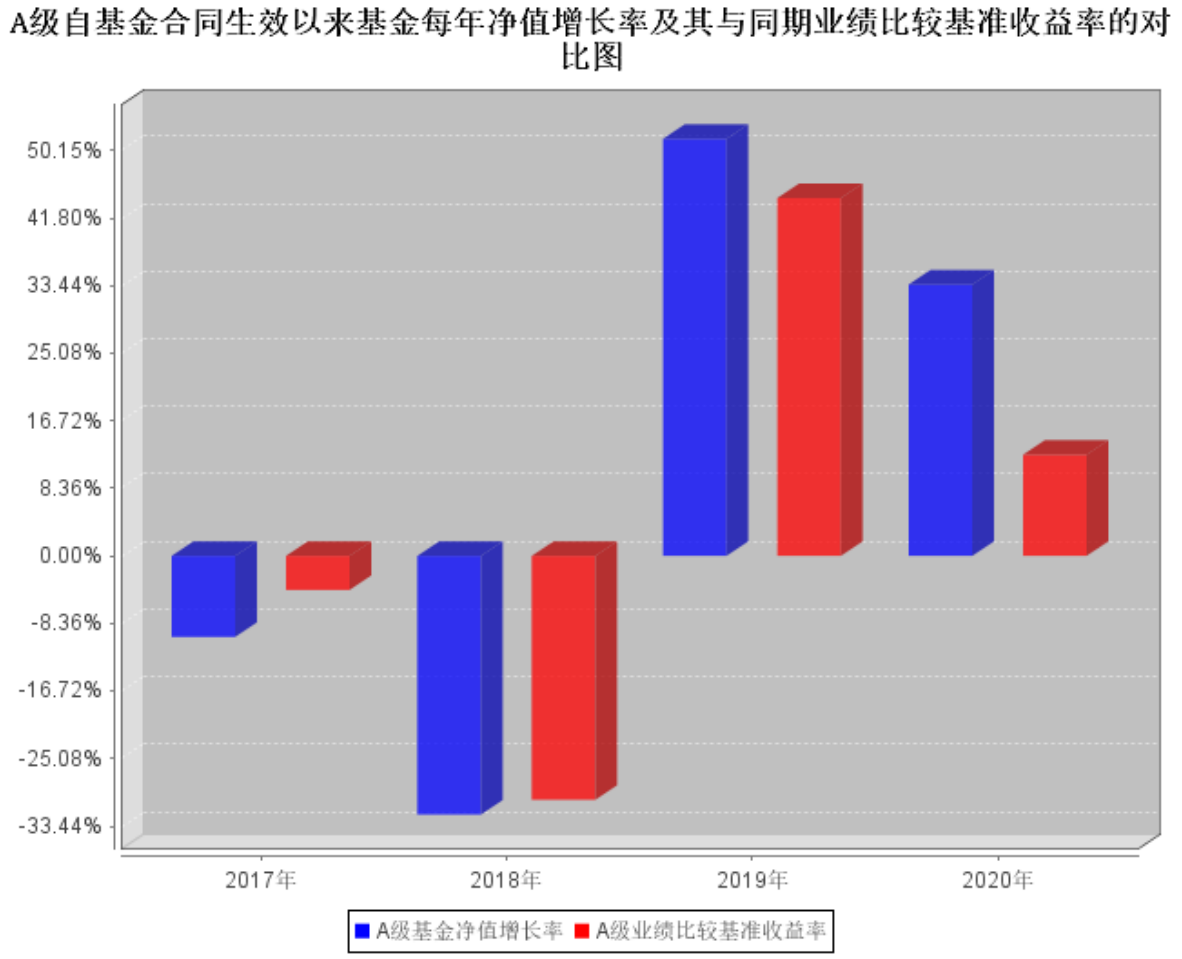
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

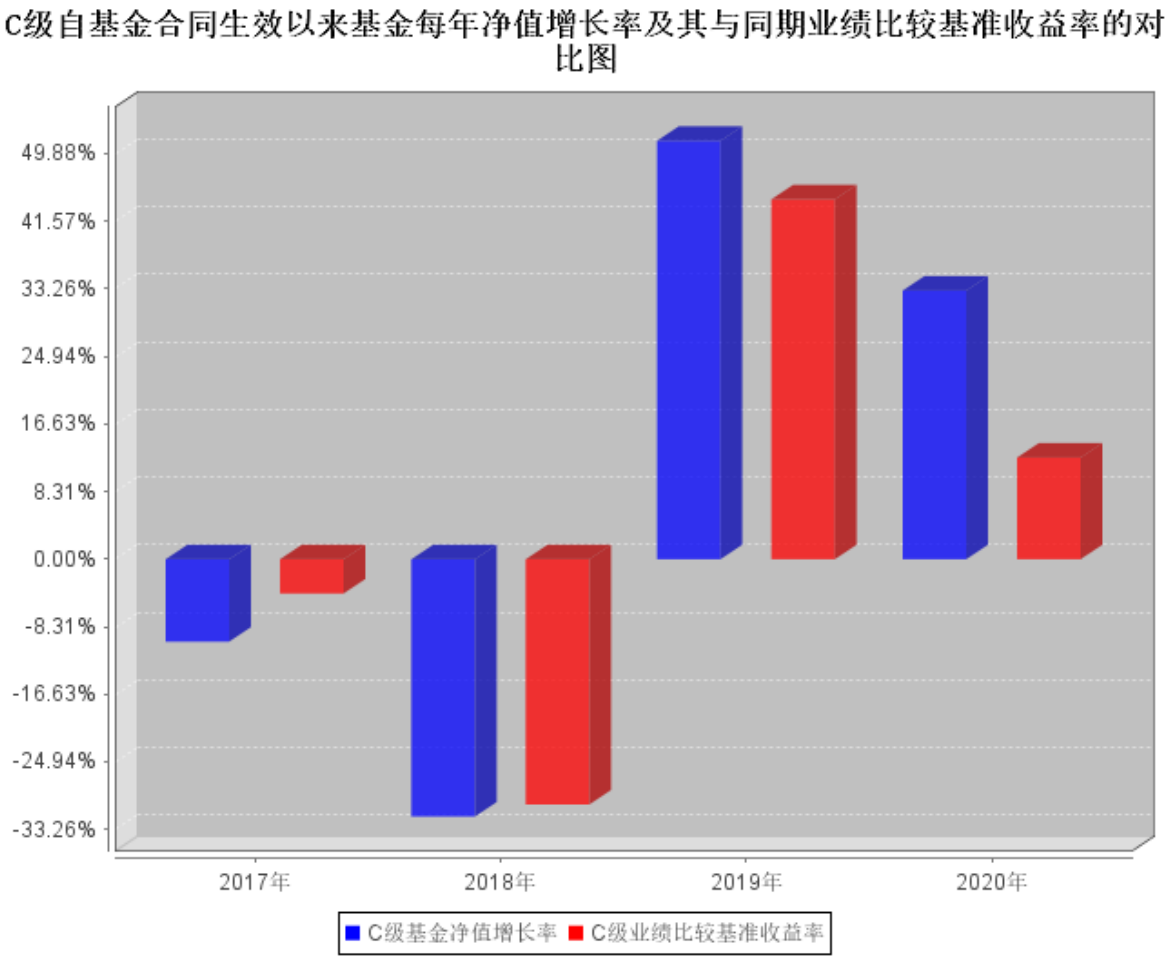




注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于信息科技主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2020 年、2019 年、2018 年会计期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2020年12月31日，本基金管理人管理着133只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数证券投资基金（LOF）、银华深证100指数分级证券投资基金、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦30股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银

华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证100交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期2030三年持有期混合型发起式基金中基

金（FOF）、银华尊和养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟39个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选18个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选15个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华长江经济带主题债券型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马君女士	本基金的基金经理	2020年9月22日	-	12.5年	硕士学位。2008年7月至2009年3月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自2012年9月4日至2020年11月30日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013年12月16日至2015年7月16日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015年8月6日至2016年8月5日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015年8月13日至2016年8月5日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投

					资基金基金经理，自2016年1月14日至2021年2月25日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自2017年9月15日至2020年12月10日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2017年11月9日至2021年2月25日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2017年11月9日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2017年12月15日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月11日起兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年1月22日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年3月20日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年5月28日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2020年9月22日起兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年9月29日起兼任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）基金经理，自2020年12月10日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月3日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
李宜璇女士	本基金的基金经理	2018年3月7日	-	7年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014年12月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2017年12月25日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自2018年3月7日至

					2020年12月31日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2021年1月13日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2021年2月25日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2018年3月7日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年9月29日起兼任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）基金经理，自2020年10月29日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2021年1月1日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自2021年1月5日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月4日起兼任银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月9日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月10日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017年10月12日	-	8.5年	硕士学位，曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司，2015年加入银华基金，历任量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2020年1月10日	-	9.5年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012年8月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、李宜璇女士自2021年2月25日起不再担任本基金基金经理职务。

4、由于本基金基金经理马君女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，本基金管理人决定自2021年3月3日起暂由本公司基金经理李宜璇女士代为管理本基金。

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、《银华信息科技量化优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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

对照2011年8月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人又对上述制度进行了修改完善，进一步修订了公平交易的范围，修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点，并强调了本基金管理人内部控制的要求，具体控制方法为：1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现，不掺杂任何的人为判断，所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行，公平交易程序自动启动；2、一般情况下，场外交易指令以组合的名义

下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生03.2系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

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

在研究分析环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。

在投资决策环节，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

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

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

本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单

边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有1次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年全年，宏观经济层面，新冠疫情成为2020年全球经济的最大预期外变量。随着疫情在国内快速得到控制，国内经济得以在较快时间内逐步推进复苏。同时受益于居民资产配置方式转变、海外资金流入与全球产业链重构等多重因素的共振，A股市场表现良好。2020年全年，创业板上涨65.0%，沪深300上涨27.2%。信息科技类行业中，电子元器件行业上涨34%，计算机行业上涨16.9%，通信设备行业下跌8.7%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华信息科技量化股票发起式A基金份额净值为1.2388元，本报告期基金份额净值增长率为33.58%；截至本报告期末银华信息科技量化股票发起式C基金份额净值为1.2376元，本报告期基金份额净值增长率为33.06%；同期业绩比较基准收益率为12.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021，5G将带动全球流量持续增长，将迎来流量基建和生产的正循环，同时5G带来更丰富的通讯形式和更精致的通讯体验，带动全球流量增速回升。2021年流量产业链投资还将以基建为主，而5G应用的流量生产新环节是看点。计算机板块，2021年Q1在低基数背景下，有高增长、成长性强的预期。持续关注年度景气度较好的领域智能汽车、工业软件、医疗IT和金融IT。随着5G的深入发展，后端云计算，物联网相关的行业将会迎来快速成长。相关领域龙头企业具备明确的持续成长动能。我们将根据市场变化对组合进行持续的优化调整，运用自行开发的量化投资模型，精选细分子行业个股，力争实现超越行业的阿尔法收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及

基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期未进行利润分配。

4.9 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为2017年9月15日至2020年2月26日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为2020年3月18日至2020年4月29日。

§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，本基金托管人在对银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金的基金管理人——银华基金管理股份有限公司在银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2020年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第61329181_A50号

6.2 审计报告的基本内容

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

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

	报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺　耀
会计师事务所的地址	中国　北京	
审计报告日期	2021年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日： 2020年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	50,315,947.56	1,994,985.19
结算备付金		857,552.60	128,440.29
存出保证金		57,914.64	4,457.29
交易性金融资产	7.4.7.2	245,479,952.39	23,266,131.39
其中：股票投资		245,479,952.39	23,266,131.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,981.73	500.50
应收股利		-	-
应收申购款		563,337.32	46,755.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		297,280,686.24	25,441,270.57
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020年12月31日**	**上年度末 2019年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		669,038.74	155,207.65
应付管理人报酬		245,449.02	21,753.74
应付托管费		24,544.89	2,175.36
应付销售服务费		3,583.36	2,822.40
应付交易费用	7.4.7.7	392,042.28	77,006.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,542.48	40,164.30
负债合计		1,495,200.77	299,130.06
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	238,776,806.35	27,086,828.95
未分配利润	7.4.7.10	57,008,679.12	-1,944,688.44
所有者权益合计		295,785,485.47	25,142,140.51

负债和所有者权益总计		297,280,686.24	25,441,270.57

注：报告截止日2020年12月31日，银华信息科技量化股票发起式A类基金份额净值人民币1.2388元，银华信息科技量化股票发起式C类基金份额净值人民币1.2376元；基金份额总额238,776,806.35份，其中银华信息科技量化股票发起式A类基金份额总额230,236,043.08份，银华信息科技量化股票发起式C类基金份额总额8,540,763.27份。

7.2 利润表

会计主体：银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
一、收入		11,209,578.04	7,915,217.29
1.利息收入		111,392.01	20,141.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	111,392.01	20,141.56
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,525,514.46	4,854,337.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,299,183.11	4,722,956.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	226,331.35	131,380.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,224,867.90	2,903,103.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	347,803.67	137,634.75
减：二、费用		3,526,995.24	722,737.59
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,374,140.72	227,132.19
2．托管费	7.4.10.2.2	137,414.00	22,713.19
3．销售服务费	7.4.10.2.3	51,761.18	31,590.66
4．交易费用	7.4.7.19	1,800,829.14	399,006.55
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	7.4.7.20	162,850.20	42,295.00
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		7,682,582.80	7,192,479.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,682,582.80	7,192,479.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	27,086,828.95	-1,944,688.44	25,142,140.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,682,582.80	7,682,582.80
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）	211,689,977.40	51,270,784.76	262,960,762.16
其中：1.基金申购款	297,552,519.52	64,722,597.34	362,275,116.86
2.基金赎回款	-85,862,542.12	-13,451,812.58	-99,314,354.70
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）	238,776,806.35	57,008,679.12	295,785,485.47
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,488,490.36	-7,555,839.68	11,932,650.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,192,479.70	7,192,479.70
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）	7,598,338.59	-1,581,328.46	6,017,010.13
其中：1.基金申购款	55,552,276.94	-9,883,245.05	45,669,031.89
2.基金赎回款	-47,953,938.35	8,301,916.59	-39,652,021.76
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（基	27,086,828.95	-1,944,688.44	25,142,140.51

金净值）			

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1078号《关于准予银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2017年8月14日至2017年9月8日向社会公开募集，基金合同于2017年9月15日生效，首次设立募集规模为16,045,923.77份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、中期票据、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、非金融企业债务融资工具、银行存款（包括定期存款和协议存款及其他银行存款）、金融衍生品（股指期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为80%-95%；投资于信息科技主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。待基金投资其他品种的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致，并在履行适当程序后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金投资其他品种的

风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项，将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。本基金的业绩比较基准为：中信计算机指数收益率×30%＋中信通信指数收益率×30%＋中信电子元器件指数收益率×30%＋商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调

整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时

不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投方式免收再投资的费用；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在指定媒介上公告，且不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、

债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人

运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	50,315,947.56	1,994,985.19
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：	50,315,947.56	1,994,985.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		239,864,106.40	245,479,952.39	5,615,845.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		239,864,106.40	245,479,952.39	5,615,845.99
项目		上年度末 2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		21,875,153.30	23,266,131.39	1,390,978.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		21,875,153.30	23,266,131.39	1,390,978.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	5,528.64	434.72
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	424.49	63.58

应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	28.60	2.20
合计	5,981.73	500.50

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	392,042.28	77,006.61
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	392,042.28	77,006.61

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	542.48	164.30
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	160,000.00	40,000.00
合计	160,542.48	40,164.30

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银华信息科技量化股票发起式A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,792,199.00	18,792,199.00
本期申购	261,496,885.84	261,496,885.84
本期赎回（以“-”号填列）	-50,053,041.76	-50,053,041.76

- 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	230,236,043.08	230,236,043.08

金额单位：人民币元

银华信息科技量化股票发起式C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,294,629.95	8,294,629.95
本期申购	36,055,633.68	36,055,633.68
本期赎回（以“-”号填列）	-35,809,500.36	-35,809,500.36
- 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	8,540,763.27	8,540,763.27

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银华信息科技量化股票发起式A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,131,820.15	1,767,230.88	-1,364,589.27
本期利润	1,266,417.80	4,280,993.25	5,547,411.05
本期基金份额交易产生的变动数	13,360,706.58	37,436,096.54	50,796,803.12
其中：基金申购款	12,316,617.07	46,270,866.12	58,587,483.19
基金赎回款	1,044,089.51	-8,834,769.58	-7,790,680.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,495,304.23	43,484,320.67	54,979,624.90

单位：人民币元

银华信息科技量化股票发起式C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,362,348.92	782,249.75	-580,099.17
本期利润	2,191,297.10	-56,125.35	2,135,171.75
本期基金份额交易产生的变动数	-416,887.60	890,869.24	473,981.64

其中：基金申购款	-1,195,972.18	7,331,086.33	6,135,114.15
基金赎回款	779,084.58	-6,440,217.09	-5,661,132.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	412,060.58	1,616,993.64	2,029,054.22

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	102,636.71	18,280.10
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	8,394.12	1,801.56
其他	361.18	59.90
合计	111,392.01	20,141.56

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,299,183.11	4,722,956.27
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	6,299,183.11	4,722,956.27

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	570,292,956.01	135,947,230.96
减：卖出股票成本总额	563,993,772.90	131,224,274.69
买卖股票差价收入	6,299,183.11	4,722,956.27

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	226,331.35	131,380.93
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	226,331.35	131,380.93

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	4,224,867.90	2,903,103.78
——股票投资	4,224,867.90	2,903,103.78
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	-	-

值税		
合计	4,224,867.90	2,903,103.78

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	296,782.33	107,982.18
转换费收入	51,021.34	9,652.57
其他收入	-	20,000.00
合计	347,803.67	137,634.75

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,800,829.14	399,006.55
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	1,800,829.14	399,006.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,850.20	2,295.00
合计	162,850.20	42,295.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

注1：根据2020年12月2日《银华基金管理股份有限公司关于股东名称变更的公告》，股东山西海鑫实业股份有限公司更名为山西海鑫实业有限公司。

注2：根据2020年10月24日《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称、住所及法定代表人变更的公告》，子公司银华资本管理（珠海横琴）有限公司更名为银华长安资本管理（北京）有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券	-	-	3,222,937.88	1.16%

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	2,356.91	0.99%	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,374,140.72	227,132.19
其中：支付销售机构的客户维护费	123,358.26	63,904.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	137,414.00	22,713.19

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	2,774.56	2,774.56
中国工商银行	-	11,452.94	11,452.94
第一创业	-	25.52	25.52
西南证券	-	0.16	0.16
合计	-	14,253.18	14,253.18

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	807.65	807.65
中国工商银行	-	4,671.03	4,671.03
合计	-	5,478.68	5,478.68

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.40%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2020年1月1日至2020年12月31日	
	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C
基金合同生效日（2017年9月15日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
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	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额	4.34%	-

占基金总份额比例		

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C
基金合同生效日（2017年9月15日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
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	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.22%	-

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	50,315,947.56	102,636.71	1,994,985.19	18,280.10

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新发流通受限	24.87	33.51	364	9,052.68	12,197.64	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新发流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新发流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新发流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新发流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新发流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新发流通受限	118.27	603.36	104	12,300.08	62,749.44	-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新发流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	新发流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	新发流通受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300909	汇创达	2020年11月11	2021年5月	新发流通受限	29.57	40.67	372	11,000.04	15,129.24	-

		日	18日							
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新发流通受限	30.26	47.87	324	9,804.24	15,509.88	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新发流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新发流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新发流通受限	24.60	61.51	244	6,002.40	15,008.44	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新发流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新发流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新发流通受限	25.70	88.29	1,393	35,800.10	122,987.97	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688221	前沿生物	2020年10月20日	2021年4月28日	新发流通受限	20.50	17.15	5,510	112,955.00	94,496.50	-
688557	兰剑智能	2020年11月25日	2021年6月2日	新发流通受限	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-

688590	新致软件	2020年11月27日	2021年6月7日	新发流通受限	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,204	89,649.84	89,649.84	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	50,315,947.56	-	-	-	-	-	50,315,947.56
结算备付金	857,552.60	-	-	-	-	-	857,552.60
存出保证金	57,914.64	-	-	-	-	-	57,914.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	245,479,952.39	245,479,952.39
应收利息	-	-	-	-	-	5,981.73	5,981.73
应收申购款	15,110.00	-	-	-	-	548,227.32	563,337.32
资产总计	51,246,524.80	-	-	-	-	246,034,161.44	297,280,686.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	669,038.74	669,038.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	245,449.02	245,449.02
应付托管费	-	-	-	-	-	24,544.89	24,544.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,583.36	3,583.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	392,042.28	392,042.28
其他负债	-	-	-	-	-	160,542.48	160,542.48
负债总计	-	-	-	-	-	1,495,200.77	1,495,200.77
利率敏感度缺口	51,246,524.80	-	-	-	-	244,538,960.67	295,785,485.47
上年度末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,994,985.19	-	-	-	-	-	1,994,985.19
结算备付金	128,440.29	-	-	-	-	-	128,440.29
存出保证金	4,457.29	-	-	-	-	-	4,457.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	23,266,131.39	23,266,131.39
应收利息	-	-	-	-	-	500.50	500.50
应收申购款	100.00	-	-	-	-	46,655.91	46,755.91
资产总计	2,127,982.77	-	-	-	-	23,313,287.80	25,441,270.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	155,207.65	155,207.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,753.74	21,753.74
应付托管费	-	-	-	-	-	2,175.36	2,175.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,822.40	2,822.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	77,006.61	77,006.61
其他负债	-	-	-	-	-	40,164.30	40,164.30
负债总计	-	-	-	-	-	299,130.06	299,130.06
利率敏感度缺口	2,127,982.77	-	-	-	-	23,014,157.74	25,142,140.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	245,479,952.39	82.99	23,266,131.39	92.54
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	245,479,952.39	82.99	23,266,131.39	92.54

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；
	Beta系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了

	基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020年12月31日 ）	上年度末（ 2019年12月31日 ）
	业绩比较基准上升5%	13,601,550.25	824,085.73
	业绩比较基准下降5%	-13,601,550.25	-824,085.73

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

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

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币244,690,280.30元，属于第二层次的余额为人民币171,679.39元，属于第三层次的余额为人民币617,992.70元（上年度末：第一层次人民币23,266,131.39元，第二层次人民币0.00元，第三层次人民币0.00元）。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

注：无。

7.4.14.3 其他事项

注：无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	245,479,952.39	82.58
	其中：股票	245,479,952.39	82.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	51,173,500.16	17.21
8	其他各项资产	627,233.69	0.21
9	合计	297,280,686.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	140,648,908.01	47.55
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	466,310.72	0.16
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	60,060,785.69	20.31
J	金融业	37,838,559.33	12.79
K	房地产业	3,759,463.14	1.27
L	租赁和商务服务业	1,382,052.00	0.47
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	328,465.50	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	995,408.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	245,479,952.39	82.99

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300059	东方财富	398,805	12,362,955.00	4.18
2	002475	立讯精密	191,702	10,758,316.24	3.64
3	601318	中国平安	112,400	9,776,552.00	3.31
4	000725	京东方A	1,398,071	8,388,426.00	2.84
5	002410	广联达	78,694	6,196,365.56	2.09
6	603501	韦尔股份	25,293	5,845,212.30	1.98
7	603986	兆易创新	27,542	5,439,545.00	1.84
8	600588	用友网络	122,290	5,364,862.30	1.81
9	600036	招商银行	108,693	4,777,057.35	1.62
10	600703	三安光电	173,920	4,697,579.20	1.59
11	300394	天孚通信	75,250	4,013,082.50	1.36
12	002415	海康威视	82,651	4,009,400.01	1.36
13	300253	卫宁健康	222,800	3,899,000.00	1.32
14	002008	大族激光	83,951	3,588,905.25	1.21
15	300628	亿联网络	47,325	3,460,404.00	1.17
16	300136	信维通信	92,921	3,334,005.48	1.13
17	300308	中际旭创	64,899	3,300,763.14	1.12
18	300502	新易盛	57,596	3,195,426.08	1.08
19	000636	风华高科	91,621	3,087,627.70	1.04
20	600845	宝信软件	44,697	3,083,199.06	1.04
21	002241	歌尔股份	82,326	3,072,406.32	1.04
22	600570	恒生电子	29,083	3,050,806.70	1.03
23	002148	北纬科技	657,792	2,867,973.12	0.97
24	002609	捷顺科技	304,690	2,836,663.90	0.96
25	600030	中信证券	95,400	2,804,760.00	0.95
26	603236	移远通信	14,925	2,790,079.50	0.94

27	601166	兴业银行	132,900	2,773,623.00	0.94
28	300408	三环集团	73,969	2,755,345.25	0.93
29	002138	顺络电子	109,500	2,684,940.00	0.91
30	300188	美亚柏科	114,720	2,471,068.80	0.84
31	002281	光迅科技	83,303	2,419,119.12	0.82
32	300548	博创科技	69,714	2,415,590.10	0.82
33	002139	拓邦股份	293,527	2,380,503.97	0.80
34	600050	中国联通	496,604	2,214,853.84	0.75
35	002036	联创电子	211,800	2,190,012.00	0.74
36	300638	广和通	35,922	2,149,931.70	0.73
37	002230	科大讯飞	51,934	2,122,542.58	0.72
38	300496	中科创达	17,378	2,033,226.00	0.69
39	000002	万科A	70,100	2,011,870.00	0.68
40	000001	平安银行	100,900	1,951,406.00	0.66
41	300782	卓胜微	3,407	1,943,829.78	0.66
42	002409	雅克科技	30,265	1,818,623.85	0.61
43	300747	锐科激光	20,470	1,798,494.20	0.61
44	600048	保利地产	109,900	1,738,618.00	0.59
45	601231	环旭电子	87,037	1,683,295.58	0.57
46	300659	中孚信息	33,325	1,635,591.00	0.55
47	000045	深纺织A	225,326	1,615,587.42	0.55
48	002938	鹏鼎控股	30,872	1,533,412.24	0.52
49	300451	创业慧康	110,368	1,493,279.04	0.50
50	300627	华测导航	65,066	1,478,950.18	0.50
51	300454	深信服	5,961	1,478,387.61	0.50
52	000100	TCL科技	202,205	1,431,611.40	0.48
53	300679	电连技术	42,008	1,427,011.76	0.48
54	600837	海通证券	109,000	1,401,740.00	0.47
55	300762	上海瀚讯	31,730	1,373,909.00	0.46
56	601328	交通银行	297,600	1,333,248.00	0.45
57	600363	联创光电	50,726	1,249,381.38	0.42
58	600584	长电科技	28,893	1,229,975.01	0.42
59	300207	欣旺达	39,117	1,201,283.07	0.41
60	688111	金山办公	2,828	1,162,308.00	0.39
61	300687	赛意信息	48,100	1,103,414.00	0.37
62	603633	徕木股份	112,446	1,082,854.98	0.37
63	002156	通富微电	40,943	1,033,401.32	0.35
64	002402	和而泰	56,288	972,093.76	0.33
65	300559	佳发教育	72,319	969,074.60	0.33
66	300493	润欣科技	126,300	967,458.00	0.33
67	002027	分众传媒	97,100	958,377.00	0.32

68	300302	同有科技	83,638	943,436.64	0.32
69	300433	蓝思科技	30,277	926,778.97	0.31
70	300369	绿盟科技	59,727	912,628.56	0.31
71	002371	北方华创	4,985	900,988.90	0.30
72	002925	盈趣科技	13,682	880,163.06	0.30
73	300661	圣邦股份	3,223	850,227.40	0.29
74	002362	汉王科技	34,782	850,072.08	0.29
75	300115	长盈精密	33,138	816,851.70	0.28
76	000063	中兴通讯	23,759	799,490.35	0.27
77	002123	梦网集团	54,000	768,420.00	0.26
78	300413	芒果超媒	10,500	761,250.00	0.26
79	600745	闻泰科技	7,434	735,966.00	0.25
80	300383	光环新网	42,464	729,106.88	0.25
81	603160	汇顶科技	4,659	724,707.45	0.25
82	600183	生益科技	25,700	723,712.00	0.24
83	002380	科远智慧	48,659	693,390.75	0.23
84	300033	同花顺	5,301	657,217.98	0.22
85	000977	浪潮信息	24,414	656,248.32	0.22
86	002153	石基信息	20,805	646,827.45	0.22
87	300515	三德科技	61,633	642,832.19	0.22
88	688981	中芯国际	11,027	636,809.25	0.22
89	300348	长亮科技	32,696	621,224.00	0.21
90	300378	鼎捷软件	22,251	606,339.75	0.20
91	002049	紫光国微	4,475	598,799.75	0.20
92	300624	万兴科技	10,567	585,306.13	0.20
93	300010	豆神教育	59,600	581,696.00	0.20
94	002093	国脉科技	77,600	565,704.00	0.19
95	300007	汉威科技	35,681	555,196.36	0.19
96	603613	国联股份	4,299	550,615.92	0.19
97	002384	东山精密	21,053	547,378.00	0.19
98	300083	创世纪	46,071	542,716.38	0.18
99	300750	宁德时代	1,526	535,793.86	0.18
100	603267	鸿远电子	4,100	527,916.00	0.18
101	300531	优博讯	32,600	520,948.00	0.18
102	002185	华天科技	37,541	511,308.42	0.17
103	300078	思创医惠	56,358	510,039.90	0.17
104	300150	世纪瑞尔	108,900	507,474.00	0.17
105	002555	三七互娱	16,000	499,680.00	0.17
106	603019	中科曙光	14,511	496,711.53	0.17
107	601100	恒立液压	4,326	488,838.00	0.17
108	688208	道通科技	7,007	480,049.57	0.16

109	002414	高德红外	11,344	473,612.00	0.16
110	300296	利亚德	74,263	472,312.68	0.16
111	300168	万达信息	21,300	461,997.00	0.16
112	002920	德赛西威	5,456	459,067.84	0.16
113	603881	数据港	7,494	450,464.34	0.15
114	002808	恒久科技	53,716	432,950.96	0.15
115	600536	中国软件	5,494	432,707.44	0.15
116	601888	中国中免	1,500	423,675.00	0.14
117	002600	领益智造	34,237	410,501.63	0.14
118	688012	中微公司	2,600	409,734.00	0.14
119	601012	隆基股份	4,400	405,680.00	0.14
120	600460	士兰微	16,058	401,450.00	0.14
121	002405	四维图新	28,020	399,845.40	0.14
122	600519	贵州茅台	200	399,600.00	0.14
123	002439	启明星辰	13,493	394,130.53	0.13
124	300256	星星科技	62,976	387,932.16	0.13
125	300037	新宙邦	3,700	375,180.00	0.13
126	688023	安恒信息	1,392	362,059.20	0.12
127	002056	横店东磁	22,826	346,726.94	0.12
128	300563	神宇股份	13,079	345,677.97	0.12
129	002179	中航光电	4,399	344,397.71	0.12
130	688561	奇安信	2,709	341,604.90	0.12
131	002777	久远银海	14,300	333,762.00	0.11
132	002050	三花智控	13,478	332,232.70	0.11
133	002126	银轮股份	24,114	332,049.78	0.11
134	002607	中公教育	9,350	328,465.50	0.11
135	300088	长信科技	35,500	315,595.00	0.11
136	000333	美的集团	3,200	315,008.00	0.11
137	300674	宇信科技	9,201	312,189.93	0.11
138	300073	当升科技	4,800	311,280.00	0.11
139	002850	科达利	3,284	308,663.16	0.10
140	002624	完美世界	10,388	306,446.00	0.10
141	300726	宏达电子	4,200	303,870.00	0.10
142	600309	万华化学	3,300	300,432.00	0.10
143	688019	安集科技	1,000	297,800.00	0.10
144	002897	意华股份	10,969	294,188.58	0.10
145	603338	浙江鼎力	2,900	293,451.00	0.10
146	600718	东软集团	28,100	292,521.00	0.10
147	000938	紫光股份	13,685	279,858.25	0.09
148	300613	富瀚微	2,300	277,196.00	0.09
149	300035	中科电气	22,600	276,850.00	0.09

150	603933	睿能科技	24,691	274,317.01	0.09
151	688396	华润微	4,320	269,956.80	0.09
152	688039	当虹科技	4,514	265,874.60	0.09
153	002649	博彦科技	29,360	264,533.60	0.09
154	603005	晶方科技	4,000	257,440.00	0.09
155	300271	华宇软件	10,500	250,635.00	0.08
156	000701	厦门信达	48,400	246,840.00	0.08
157	603712	七一二	5,896	245,568.40	0.08
158	000050	深天马A	16,400	241,736.00	0.08
159	601633	长城汽车	6,363	240,585.03	0.08
160	300251	光线传媒	19,400	234,158.00	0.08
161	002396	星网锐捷	9,432	217,501.92	0.07
162	300866	安克创新	1,300	213,538.00	0.07
163	600660	福耀玻璃	4,300	206,615.00	0.07
164	300590	移为通信	6,661	204,159.65	0.07
165	300131	英唐智控	24,300	203,148.00	0.07
166	300213	佳讯飞鸿	27,579	195,810.90	0.07
167	603659	璞泰来	1,716	192,861.24	0.07
168	002222	福晶科技	13,948	192,063.96	0.06
169	000739	普洛药业	7,900	183,912.00	0.06
170	688536	思瑞浦	417	180,144.00	0.06
171	300014	亿纬锂能	2,185	178,077.50	0.06
172	002212	天融信	8,400	176,484.00	0.06
173	600884	杉杉股份	9,442	170,239.26	0.06
174	300773	拉卡拉	5,543	165,846.56	0.06
175	688095	福昕软件	673	162,866.00	0.06
176	603786	科博达	2,300	155,526.00	0.05
177	601689	拓普集团	3,700	142,191.00	0.05
178	300223	北京君正	1,400	128,086.00	0.04
179	002152	广电运通	11,700	124,956.00	0.04
180	300999	金龙鱼	1,393	122,987.97	0.04
181	002491	通鼎互联	29,500	120,360.00	0.04
182	002236	大华股份	5,714	113,651.46	0.04
183	002308	威创股份	22,035	110,615.70	0.04
184	002045	国光电器	11,852	103,349.44	0.03
185	688221	前沿生物	5,510	94,496.50	0.03
186	600478	科力远	18,316	89,748.40	0.03
187	688617	惠泰医疗	1,204	89,649.84	0.03
188	688008	澜起科技	1,000	82,880.00	0.03
189	688018	乐鑫科技	471	70,004.73	0.02
190	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.02

191	300264	佳创视讯	16,483	63,459.55	0.02
192	300322	硕贝德	4,836	63,448.32	0.02
193	300896	爱美客	104	62,749.44	0.02
194	603496	恒为科技	3,896	61,751.60	0.02
195	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.02
196	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
197	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
198	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
199	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
200	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
201	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
202	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
203	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
204	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.01
205	300910	瑞丰新材	324	15,509.88	0.01
206	300909	汇创达	372	15,129.24	0.01
207	300919	中伟股份	244	15,008.44	0.01
208	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
209	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
210	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
211	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
212	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
213	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
214	300884	狄耐克	364	12,197.64	0.00
215	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
216	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
217	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
218	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
219	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
220	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
221	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	18,871,931.39	75.06
2	300059	东方财富	16,861,296.94	67.06

3	000725	京东方A	16,401,430.00	65.23
4	600570	恒生电子	15,355,510.80	61.07
5	603986	兆易创新	14,889,366.40	59.22
6	300136	信维通信	12,333,766.97	49.06
7	600588	用友网络	11,659,140.45	46.37
8	002371	北方华创	11,415,099.88	45.40
9	603501	韦尔股份	10,678,284.00	42.47
10	600050	中国联通	10,084,871.00	40.11
11	002410	广联达	9,693,672.03	38.56
12	002415	海康威视	9,299,506.67	36.99
13	600745	闻泰科技	9,260,052.00	36.83
14	300033	同花顺	9,173,796.35	36.49
15	601318	中国平安	8,923,460.00	35.49
16	300383	光环新网	8,562,011.70	34.05
17	002439	启明星辰	8,544,299.43	33.98
18	300502	新易盛	8,519,237.08	33.88
19	000063	中兴通讯	8,380,582.00	33.33
20	002008	大族激光	8,292,042.21	32.98
21	000938	紫光股份	7,718,738.20	30.70
22	002241	歌尔股份	7,622,348.20	30.32
23	300408	三环集团	7,599,460.72	30.23
24	300454	深信服	7,328,735.29	29.15
25	300308	中际旭创	7,280,215.74	28.96
26	000977	浪潮信息	7,220,039.79	28.72
27	300496	中科创达	7,199,297.84	28.63
28	002049	紫光国微	7,101,650.60	28.25
29	300638	广和通	6,605,645.20	26.27
30	600703	三安光电	6,591,592.49	26.22
31	000636	风华高科	6,573,504.06	26.15
32	600845	宝信软件	6,570,720.00	26.13
33	601231	环旭电子	6,443,848.23	25.63
34	300628	亿联网络	6,332,407.50	25.19
35	300188	美亚柏科	5,920,112.20	23.55
36	603236	移远通信	5,726,734.60	22.78
37	300394	天孚通信	5,709,553.93	22.71
38	002938	鹏鼎控股	5,679,849.12	22.59
39	300369	绿盟科技	5,617,109.47	22.34
40	300253	卫宁健康	5,494,641.40	21.85

41	002230	科大讯飞	5,490,451.77	21.84
42	002138	顺络电子	5,428,285.00	21.59
43	002609	捷顺科技	5,294,740.20	21.06
44	300455	康拓红外	5,197,305.52	20.67
45	300590	移为通信	5,073,730.05	20.18
46	002281	光迅科技	5,008,698.00	19.92
47	300207	欣旺达	4,963,320.00	19.74
48	603019	中科曙光	4,883,874.72	19.43
49	002148	北纬科技	4,627,930.60	18.41
50	300515	三德科技	4,551,098.00	18.10
51	300548	博创科技	4,502,598.80	17.91
52	002396	星网锐捷	4,497,551.17	17.89
53	600183	生益科技	4,495,765.61	17.88
54	300078	思创医惠	4,432,884.46	17.63
55	300679	电连技术	4,352,441.00	17.31
56	300451	创业慧康	4,266,895.00	16.97
57	300782	卓胜微	4,207,669.00	16.74
58	000050	深天马A	4,172,183.00	16.59
59	600036	招商银行	4,150,460.99	16.51
60	300604	长川科技	4,059,059.05	16.14
61	000100	TCL科技	3,985,376.00	15.85
62	002212	天融信	3,941,999.10	15.68
63	300659	中孚信息	3,921,189.76	15.60
64	002409	雅克科技	3,901,709.97	15.52
65	300476	胜宏科技	3,840,993.32	15.28
66	300302	同有科技	3,778,921.61	15.03
67	300433	蓝思科技	3,549,544.16	14.12
68	000701	厦门信达	3,529,094.98	14.04
69	000045	深纺织A	3,449,755.00	13.72
70	603881	数据港	3,446,720.00	13.71
71	300379	东方通	3,379,293.00	13.44
72	300773	拉卡拉	3,282,147.00	13.05
73	300150	世纪瑞尔	3,275,688.00	13.03
74	002402	和而泰	3,225,812.00	12.83
75	002139	拓邦股份	3,197,983.00	12.72
76	002153	石基信息	3,128,087.40	12.44
77	300563	神宇股份	3,079,731.00	12.25
78	300327	中颖电子	3,032,030.94	12.06

79	300559	佳发教育	2,997,461.50	11.92
80	300624	万兴科技	2,885,891.79	11.48
81	600030	中信证券	2,851,137.39	11.34
82	002484	江海股份	2,772,465.00	11.03
83	300390	天华超净	2,765,135.00	11.00
84	300674	宇信科技	2,728,231.00	10.85
85	300747	锐科激光	2,640,547.08	10.50
86	300348	长亮科技	2,586,452.18	10.29
87	300182	捷成股份	2,572,852.61	10.23
88	603613	国联股份	2,568,283.25	10.22
89	300661	圣邦股份	2,564,299.25	10.20
90	688981	中芯国际	2,550,428.81	10.14
91	603003	龙宇燃油	2,548,991.00	10.14
92	002036	联创电子	2,527,151.00	10.05
93	002380	科远智慧	2,503,886.00	9.96
94	300378	鼎捷软件	2,466,523.00	9.81
95	002156	通富微电	2,400,519.86	9.55
96	002916	深南电路	2,363,983.31	9.40
97	603688	石英股份	2,319,517.00	9.23
98	600552	凯盛科技	2,307,613.00	9.18
99	603803	瑞斯康达	2,279,765.00	9.07
100	002384	东山精密	2,259,970.00	8.99
101	300627	华测导航	2,240,559.00	8.91
102	688111	金山办公	2,152,658.45	8.56
103	601166	兴业银行	2,143,167.00	8.52
104	002362	汉王科技	2,137,520.00	8.50
105	002724	海洋王	2,090,350.00	8.31
106	603005	晶方科技	2,054,848.80	8.17
107	002056	横店东磁	2,054,495.00	8.17
108	300223	北京君正	2,027,751.40	8.07
109	603160	汇顶科技	2,026,888.66	8.06
110	300323	华灿光电	2,014,612.00	8.01
111	300002	神州泰岳	2,012,526.00	8.00
112	000002	万科A	1,973,634.00	7.85
113	300602	飞荣达	1,916,266.05	7.62
114	300212	易华录	1,849,382.00	7.36
115	600048	保利地产	1,832,581.00	7.29
116	600536	中国软件	1,829,902.00	7.28

117	300531	优博讯	1,804,457.51	7.18
118	300762	上海瀚讯	1,796,042.00	7.14
119	600206	有研新材	1,785,408.00	7.10
120	300083	创世纪	1,757,663.00	6.99
121	300462	华铭智能	1,752,233.00	6.97
122	300672	国科微	1,741,227.00	6.93
123	600800	天津磁卡	1,739,976.99	6.92
124	600884	杉杉股份	1,730,513.87	6.88
125	600584	长电科技	1,628,343.00	6.48
126	600363	联创光电	1,617,354.00	6.43
127	688086	紫晶存储	1,607,280.37	6.39
128	000001	平安银行	1,580,440.00	6.29
129	603690	至纯科技	1,573,977.00	6.26
130	600837	海通证券	1,543,096.00	6.14
131	300213	佳讯飞鸿	1,529,419.00	6.08
132	600751	海航科技	1,529,146.00	6.08
133	300115	长盈精密	1,470,294.52	5.85
134	603189	网达软件	1,439,395.00	5.73
135	300709	精研科技	1,414,185.75	5.62
136	002106	莱宝高科	1,412,727.00	5.62
137	601328	交通银行	1,383,840.00	5.50
138	300010	豆神教育	1,371,885.00	5.46
139	603228	景旺电子	1,368,241.77	5.44
140	603659	璞泰来	1,363,170.00	5.42
141	002273	水晶光电	1,347,951.00	5.36
142	300523	辰安科技	1,341,015.00	5.33
143	002649	博彦科技	1,331,332.00	5.30
144	000032	深桑达A	1,319,888.00	5.25
145	300088	长信科技	1,315,916.00	5.23
146	002859	洁美科技	1,296,101.00	5.16
147	002376	新北洋	1,294,612.00	5.15
148	002815	崇达技术	1,291,826.00	5.14
149	300271	华宇软件	1,266,810.00	5.04
150	000823	超声电子	1,253,909.00	4.99
151	002600	领益智造	1,246,903.00	4.96
152	002236	大华股份	1,227,500.00	4.88
153	600707	彩虹股份	1,223,757.00	4.87
154	300768	迪普科技	1,201,567.00	4.78

155	600110	诺德股份	1,187,821.00	4.72
156	300296	利亚德	1,183,237.00	4.71
157	300687	赛意信息	1,179,755.00	4.69
158	002897	意华股份	1,176,410.00	4.68
159	002528	英飞拓	1,169,721.00	4.65
160	002925	盈趣科技	1,168,971.00	4.65
161	300613	富瀚微	1,167,757.00	4.64
162	002063	远光软件	1,133,250.40	4.51
163	002777	久远银海	1,127,813.00	4.49
164	603633	徕木股份	1,107,344.66	4.40
165	002123	梦网集团	1,074,728.00	4.27
166	300036	超图软件	1,072,127.00	4.26
167	300275	梅安森	1,058,754.00	4.21
168	300331	苏大维格	1,051,721.53	4.18
169	300493	润欣科技	1,036,178.00	4.12
170	603712	七一二	1,035,520.00	4.12
171	002745	木林森	1,030,412.00	4.10
172	603989	艾华集团	1,018,113.00	4.05
173	300219	鸿利智汇	1,014,705.00	4.04
174	600460	士兰微	1,013,609.00	4.03
175	002636	金安国纪	977,586.00	3.89
176	002185	华天科技	951,988.00	3.79
177	300042	朗科科技	942,225.00	3.75
178	002970	锐明技术	935,194.00	3.72
179	688095	福昕软件	924,764.80	3.68
180	300333	兆日科技	912,789.00	3.63
181	002449	国星光电	904,583.50	3.60
182	603508	思维列控	902,534.00	3.59
183	002456	欧菲光	897,413.00	3.57
184	300183	东软载波	897,378.00	3.57
185	688208	道通科技	881,068.56	3.50
186	002027	分众传媒	866,686.00	3.45
187	300007	汉威科技	855,257.00	3.40
188	300525	博思软件	851,341.58	3.39
189	002387	维信诺	847,914.00	3.37
190	300552	万集科技	843,450.00	3.35
191	600071	凤凰光学	843,216.00	3.35
192	688023	安恒信息	839,060.37	3.34

193	300603	立昂技术	835,752.00	3.32
194	300395	菲利华	831,816.00	3.31
195	603890	春秋电子	831,267.00	3.31
196	600718	东软集团	828,515.00	3.30
197	002231	奥维通信	827,400.00	3.29
198	002414	高德红外	820,871.00	3.26
199	600100	同方股份	816,981.00	3.25
200	300074	华平股份	816,249.00	3.25
201	300562	乐心医疗	812,442.14	3.23
202	300545	联得装备	809,093.00	3.22
203	300319	麦捷科技	799,528.00	3.18
204	601138	工业富联	794,126.40	3.16
205	000988	华工科技	783,414.00	3.12
206	603626	科森科技	780,749.90	3.11
207	300014	亿纬锂能	780,507.00	3.10
208	002308	威创股份	775,422.00	3.08
209	000733	振华科技	772,896.00	3.07
210	300413	芒果超媒	772,597.00	3.07
211	300050	世纪鼎利	760,877.00	3.03
212	300229	拓尔思	758,973.00	3.02
213	002368	太极股份	758,717.21	3.02
214	000066	中国长城	749,693.31	2.98
215	300264	佳创视讯	736,670.00	2.93
216	300566	激智科技	729,693.00	2.90
217	002920	德赛西威	716,661.00	2.85
218	002115	三维通信	696,132.80	2.77
219	300771	智莱科技	695,422.00	2.77
220	688012	中微公司	681,203.42	2.71
221	002947	恒铭达	679,254.00	2.70
222	002405	四维图新	672,044.00	2.67
223	300726	宏达电子	656,609.00	2.61
224	300750	宁德时代	652,918.00	2.60
225	300232	洲明科技	640,885.00	2.55
226	300211	亿通科技	624,068.00	2.48
227	002555	三七互娱	616,606.00	2.45
228	688039	当虹科技	615,654.08	2.45
229	603421	鼎信通讯	615,073.00	2.45
230	603496	恒为科技	609,044.00	2.42

231	002045	国光电器	603,817.00	2.40
232	300301	长方集团	602,849.00	2.40
233	603297	永新光学	598,465.00	2.38
234	002655	共达电声	594,215.00	2.36
235	002093	国脉科技	593,485.00	2.36
236	300666	江丰电子	587,301.00	2.34
237	300256	星星科技	582,630.56	2.32
238	002222	福晶科技	578,525.00	2.30
239	300555	路通视信	572,920.00	2.28
240	300373	扬杰科技	569,337.00	2.26
241	000021	深科技	553,110.96	2.20
242	300735	光弘科技	547,598.80	2.18
243	688561	奇安信	539,654.60	2.15
244	603380	易德龙	537,667.00	2.14
245	603328	依顿电子	535,517.00	2.13
246	002129	中环股份	524,619.00	2.09
247	002796	世嘉科技	513,782.00	2.04

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	12,603,886.51	50.13
2	002475	立讯精密	10,777,909.74	42.87
3	603986	兆易创新	10,513,492.32	41.82
4	002371	北方华创	10,190,103.65	40.53
5	000725	京东方A	9,618,674.69	38.26
6	300033	同花顺	8,806,541.63	35.03
7	600745	闻泰科技	8,085,406.09	32.16
8	600050	中国联通	7,856,763.33	31.25
9	002439	启明星辰	7,754,619.52	30.84
10	000938	紫光股份	7,540,558.44	29.99
11	300059	东方财富	7,442,784.43	29.60
12	300136	信维通信	7,321,906.64	29.12
13	002415	海康威视	7,237,991.67	28.79
14	002049	紫光国微	7,105,372.97	28.26
15	600588	用友网络	6,822,864.55	27.14
16	300383	光环新网	6,801,378.14	27.05
17	000063	中兴通讯	6,746,631.60	26.83

18	000977	浪潮信息	6,503,485.00	25.87
19	300496	中科创达	6,088,746.13	24.22
20	603501	韦尔股份	6,043,555.59	24.04
21	300408	三环集团	5,972,561.82	23.76
22	300454	深信服	5,617,589.73	22.34
23	002008	大族激光	5,475,417.39	21.78
24	300590	移为通信	5,139,577.89	20.44
25	300502	新易盛	5,095,515.29	20.27
26	601231	环旭电子	4,984,563.77	19.83
27	300455	康拓红外	4,699,831.57	18.69
28	002241	歌尔股份	4,671,639.93	18.58
29	300369	绿盟科技	4,567,613.89	18.17
30	300604	长川科技	4,493,438.40	17.87
31	002410	广联达	4,436,877.15	17.65
32	300207	欣旺达	4,410,767.47	17.54
33	300638	广和通	4,299,287.92	17.10
34	002938	鹏鼎控股	4,187,041.89	16.65
35	002396	星网锐捷	4,152,857.70	16.52
36	300476	胜宏科技	4,108,722.61	16.34
37	603019	中科曙光	4,084,029.29	16.24
38	300515	三德科技	4,061,701.83	16.15
39	600845	宝信软件	3,939,827.57	15.67
40	600183	生益科技	3,885,337.85	15.45
41	000050	深天马A	3,883,405.94	15.45
42	002212	天融信	3,829,403.68	15.23
43	300188	美亚柏科	3,786,435.41	15.06
44	002230	科大讯飞	3,723,161.61	14.81
45	300379	东方通	3,693,331.61	14.69
46	300078	思创医惠	3,547,816.51	14.11
47	300433	蓝思科技	3,499,877.03	13.92
48	000701	厦门信达	3,497,943.13	13.91
49	000636	风华高科	3,485,163.78	13.86
50	300628	亿联网络	3,354,454.77	13.34
51	300451	创业慧康	3,209,634.76	12.77
52	300308	中际旭创	3,199,792.29	12.73
53	300150	世纪瑞尔	3,135,257.91	12.47
54	300390	天华超净	3,081,594.05	12.26
55	300327	中颖电子	3,034,702.11	12.07
56	300773	拉卡拉	2,988,128.26	11.88
57	002138	顺络电子	2,950,453.71	11.74
58	002484	江海股份	2,903,221.53	11.55

59	300782	卓胜微	2,818,084.41	11.21
60	300182	捷成股份	2,815,759.44	11.20
61	603236	移远通信	2,773,125.26	11.03
62	000100	TCL科技	2,751,572.01	10.94
63	300674	宇信科技	2,692,232.69	10.71
64	300563	神宇股份	2,690,272.73	10.70
65	300679	电连技术	2,679,085.77	10.66
66	603881	数据港	2,637,082.03	10.49
67	300659	中孚信息	2,607,845.24	10.37
68	002281	光迅科技	2,560,450.59	10.18
69	002153	石基信息	2,560,170.91	10.18
70	002916	深南电路	2,518,959.82	10.02
71	300253	卫宁健康	2,517,639.34	10.01
72	603003	龙宇燃油	2,486,532.51	9.89
73	300302	同有科技	2,443,762.91	9.72
74	300323	华灿光电	2,389,955.68	9.51
75	600552	凯盛科技	2,331,607.80	9.27
76	603803	瑞斯康达	2,327,373.82	9.26
77	002402	和而泰	2,313,230.31	9.20
78	002724	海洋王	2,312,236.32	9.20
79	002409	雅克科技	2,306,076.81	9.17
80	300223	北京君正	2,303,637.89	9.16
81	603613	国联股份	2,281,981.60	9.08
82	300661	圣邦股份	2,256,499.14	8.97
83	300348	长亮科技	2,177,836.54	8.66
84	300002	神州泰岳	2,025,735.32	8.06
85	300624	万兴科技	1,991,063.13	7.92
86	603688	石英股份	1,974,703.16	7.85
87	300394	天孚通信	1,963,049.54	7.81
88	000045	深纺织A	1,952,958.51	7.77
89	600703	三安光电	1,931,010.45	7.68
90	002609	捷顺科技	1,924,719.96	7.66
91	603005	晶方科技	1,903,758.34	7.57
92	603160	汇顶科技	1,888,076.02	7.51
93	002380	科远智慧	1,872,355.34	7.45
94	600800	天津磁卡	1,861,432.81	7.40
95	600751	海航科技	1,858,042.96	7.39
96	300212	易华录	1,846,041.61	7.34
97	300462	华铭智能	1,826,828.72	7.27
98	600206	有研新材	1,809,220.68	7.20
99	300559	佳发教育	1,795,287.04	7.14

100	002056	横店东磁	1,792,595.23	7.13
101	688086	紫晶存储	1,770,693.82	7.04
102	300672	国科微	1,759,507.97	7.00
103	300378	鼎捷软件	1,704,326.85	6.78
104	300602	飞荣达	1,688,210.97	6.71
105	600884	杉杉股份	1,662,753.40	6.61
106	688981	中芯国际	1,634,037.27	6.50
107	002384	东山精密	1,629,448.41	6.48
108	603690	至纯科技	1,610,569.38	6.41
109	300548	博创科技	1,532,267.23	6.09
110	002156	通富微电	1,529,783.32	6.08
111	002148	北纬科技	1,424,729.91	5.67
112	603189	网达软件	1,396,832.31	5.56
113	603659	璞泰来	1,395,627.49	5.55
114	002273	水晶光电	1,361,735.76	5.42
115	603228	景旺电子	1,351,878.71	5.38
116	688111	金山办公	1,344,552.96	5.35
117	002106	莱宝高科	1,332,573.18	5.30
118	600707	彩虹股份	1,312,745.28	5.22
119	002859	洁美科技	1,309,858.38	5.21
120	300709	精研科技	1,306,532.10	5.20
121	002649	博彦科技	1,278,626.54	5.09
122	002236	大华股份	1,278,346.77	5.08
123	300213	佳讯飞鸿	1,277,141.10	5.08
124	000032	深桑达A	1,274,841.31	5.07
125	002376	新北洋	1,270,985.81	5.06
126	300395	菲利华	1,269,826.71	5.05
127	600536	中国软件	1,261,596.10	5.02
128	600110	诺德股份	1,239,588.33	4.93
129	000823	超声电子	1,234,787.58	4.91
130	002362	汉王科技	1,201,772.91	4.78
131	300531	优博讯	1,201,741.94	4.78
132	300523	辰安科技	1,201,324.98	4.78
133	002815	崇达技术	1,176,373.28	4.68
134	002745	木林森	1,169,645.19	4.65
135	300768	迪普科技	1,167,525.44	4.64
136	002636	金安国纪	1,160,351.63	4.62
137	300083	创世纪	1,144,306.84	4.55
138	300747	锐科激光	1,121,259.42	4.46
139	300271	华宇软件	1,120,617.56	4.46
140	300219	鸿利智汇	1,118,408.09	4.45

141	300036	超图软件	1,087,360.17	4.32
142	002063	远光软件	1,082,842.22	4.31
143	300333	兆日科技	1,062,885.57	4.23
144	603508	思维列控	1,052,712.40	4.19
145	300331	苏大维格	1,045,830.18	4.16
146	002528	英飞拓	1,025,148.43	4.08
147	300088	长信科技	1,008,786.43	4.01
148	300275	梅安森	999,261.84	3.97
149	300598	诚迈科技	993,214.16	3.95
150	300183	东软载波	991,543.01	3.94
151	000733	振华科技	983,041.98	3.91
152	002139	拓邦股份	936,906.00	3.73
153	002449	国星光电	932,060.52	3.71
154	603989	艾华集团	924,373.74	3.68
155	300562	乐心医疗	907,785.51	3.61
156	300042	朗科科技	907,472.68	3.61
157	002600	领益智造	863,563.67	3.43
158	002869	金溢科技	857,343.91	3.41
159	300525	博思软件	848,095.37	3.37
160	300074	华平股份	847,708.76	3.37
161	300319	麦捷科技	844,849.54	3.36
162	600071	凤凰光学	840,964.83	3.34
163	300296	利亚德	840,345.46	3.34
164	002897	意华股份	823,692.10	3.28
165	300552	万集科技	822,062.89	3.27
166	000988	华工科技	811,707.06	3.23
167	002368	太极股份	808,856.38	3.22
168	600100	同方股份	800,889.31	3.19
169	300050	世纪鼎利	800,542.95	3.18
170	600460	士兰微	799,964.33	3.18
171	300627	华测导航	799,278.35	3.18
172	603626	科森科技	798,966.44	3.18
173	601138	工业富联	798,627.05	3.18
174	603890	春秋电子	798,113.45	3.17
175	300613	富瀚微	796,896.61	3.17
176	300014	亿纬锂能	796,019.68	3.17
177	002777	久远银海	795,975.93	3.17
178	002231	奥维通信	795,733.91	3.16
179	300545	联得装备	788,568.30	3.14
180	002970	锐明技术	769,062.07	3.06
181	002387	维信诺	766,406.49	3.05

182	300603	立昂技术	763,518.17	3.04
183	300115	长盈精密	758,507.24	3.02
184	300010	豆神教育	754,456.74	3.00
185	300229	拓尔思	747,599.54	2.97
186	000066	中国长城	747,341.32	2.97
187	603712	七一二	729,679.76	2.90
188	002456	欧菲光	718,976.02	2.86
189	002947	恒铭达	707,068.76	2.81
190	002115	三维通信	704,040.16	2.80
191	300566	激智科技	683,436.95	2.72
192	002308	威创股份	653,377.15	2.60
193	300555	路通视信	643,126.01	2.56
194	300373	扬杰科技	642,929.93	2.56
195	603421	鼎信通讯	630,030.00	2.51
196	603328	依顿电子	622,089.50	2.47
197	688095	福昕软件	618,951.71	2.46
198	300232	洲明科技	605,384.54	2.41
199	300209	天泽信息	599,127.75	2.38
200	300301	长方集团	596,121.05	2.37
201	300211	亿通科技	592,329.85	2.36
202	603118	共进股份	583,666.86	2.32
203	603297	永新光学	581,693.78	2.31
204	300771	智莱科技	572,932.07	2.28
205	002129	中环股份	569,332.52	2.26
206	688126	沪硅产业	566,637.80	2.25
207	300264	佳创视讯	564,580.82	2.25
208	002655	共达电声	555,525.80	2.21
209	603496	恒为科技	552,337.28	2.20
210	000851	高鸿股份	550,812.89	2.19
211	300999	金龙鱼	550,190.86	2.19
212	300157	恒泰艾普	543,040.52	2.16
213	300666	江丰电子	542,896.00	2.16
214	603936	博敏电子	542,559.22	2.16
215	000021	深科技	541,235.36	2.15
216	600563	法拉电子	534,145.32	2.12
217	600718	东软集团	527,127.09	2.10
218	300735	光弘科技	518,597.84	2.06
219	603380	易德龙	508,696.80	2.02
220	688023	安恒信息	504,643.09	2.01
221	300226	上海钢联	503,963.28	2.00

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	782,132,436.63
卖出股票收入（成交）总额	570,292,956.01

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,914.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,981.73

5	应收申购款	563,337.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	627,233.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
银华信息科技量化股票发起式A	12,100	19,027.77	211,579,977.73	91.90%	18,656,065.35	8.10%
银华信息科技量化股票发起式C	2,279	3,747.59	-	0.00%	8,540,763.27	100.00%
合计	14,379	16,605.94	211,579,977.73	88.61%	27,196,828.62	11.39%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	银华信息科技量化股票发起式A	35,321.56	0.02%
	银华信息科技量化股票发起式C	4,360.71	0.05%
	合计	39,682.27	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	银华信息科技量化股票发起式A	0
	银华信息科技量化股票发起式C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华信息科技量化股票发起式A	0~10
	银华信息科技量化股票发起式C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,200.12	4.19	10,001,200.12	4.19	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,200.12	4.19	10,001,200.12	4.19	3年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额10,001,200.12份，其中认购份额10,000,000.00份，认购期间利息折算份额1,200.12份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华信息科技量化股票发起式A	银华信息科技量化股票发起式C
基金合同生效日（2017年9月15日）基金份额总额	13,446,397.28	2,599,526.49
本报告期期初基金份额总额	18,792,199.00	8,294,629.95
本报告期基金总申购份额	261,496,885.84	36,055,633.68
减:本报告期基金总赎回份额	50,053,041.76	35,809,500.36
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	230,236,043.08	8,540,763.27

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，报告期内本基金应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬共计人民币40,000.00元。目前的审计机构已连续为本基金提供4年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券股份有限公司	2	471,840,938.50	34.99%	345,054.90	31.27%	-
瑞银证券有限责任公司	1	224,169,608.67	16.62%	208,769.84	18.92%	-
国盛证券股份有限公司	2	193,333,997.14	14.34%	141,384.23	12.81%	-

光大证券股份有限公司	1	173,298,209.94	12.85%	161,392.48	14.62%	-
招商证券股份有限公司	1	69,499,266.44	5.15%	64,725.42	5.86%	-
东吴证券股份有限公司	2	59,009,000.17	4.38%	43,152.99	3.91%	-
东方财富证券股份有限公司	4	38,541,959.44	2.86%	35,894.35	3.25%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	37,338,167.83	2.77%	34,769.84	3.15%	-
野村东方国际证券有限公司	2	29,061,604.26	2.15%	21,252.70	1.93%	-
中泰证券股份有限公司	4	22,029,329.98	1.63%	20,515.85	1.86%	新增1个交易单元
国联证券股份有限公司	1	14,548,704.45	1.08%	13,549.04	1.23%	-
中航证券有限公司	2	8,652,958.80	0.64%	6,327.88	0.57%	-
西部证券股份有限公司	2	7,316,224.28	0.54%	6,813.41	0.62%	-
西藏同信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	4	-	-	-	-	新增2个交易单元
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增2个交易单元
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销2个交易单元
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金于本报告期未运用交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2019年第4季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年1月18日
2	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2019年第4季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年1月18日
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的浪潮信息估值方法调整的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月13日

4	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月24日
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的闻泰科技估值方法调整的公告》	中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月24日
6	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议（2020年3月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
7	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同（2020年3月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
8	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2020第1号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
9	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
10	《银华基金管理股份有限公司关于根据<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>修改旗下13只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月28日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2019年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020年4月18日
13	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2019年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年4月18日
14	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年第1季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年4月22日
15	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2020	中国证监会基金电子披露网站及本基	2020年4月22日

	年第1季度报告》	金管理人网站	
16	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2020第2号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年4月29日
17	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2020年第2号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年4月29日
18	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年7月18日
19	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2020年第2季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年7月18日
20	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年8月18日
21	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年中期报告提示性公告》	四大证券报	2020年8月28日
22	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年9月1日
23	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年9月24日
24	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2020年第3号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年9月24日
25	《银华基金管理股份有限公司关于银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告》	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年9月24日
26	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年第3季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年10月27日
27	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金2020年第3季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年10月27日
28	《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金恢复	中国证券报、中国证监会基金电子披露	2020年11月9日

	大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	网站及本基金管理人网站	
29	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为代销机构的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年11月19日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2020/08/14-2020/12/31	0.00	104,820,996.61	0.00	104,820,996.61	43.90%
	2	2020/01/01-2020/08/13	10,001,200.12	0.00	0.00	10,001,200.12	4.19%
	3	2020/08/14-2020/12/31	0.00	96,757,781.00	0.00	96,757,781.00	40.52%
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2020年3月25日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>修改旗下13只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华信息科技量化优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

13.1.2《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》

13.1.3《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》

13.1.4《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》

13.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021年3月29日