

---

# 银华食品饮料量化优选股票型发起式证券 投资基金

## 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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  
报告送出日期：2021 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 银华食品饮料量化股票发起式   |
| 交易代码       | 005235  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 11 月 9 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 105,004,446.15 份  |
| 投资目标       | 本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于食品饮料主题相关的上市公司，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       | 本基金投资于食品饮料主题，使用主动量化策略对食品饮料主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪食品饮料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%；投资于食品饮料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。             |                     |
| 业绩比较基准          | 中证食品饮料指数收益率 $\times$ 90% + 商业银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 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。                |                     |
| 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  |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 银华食品饮料量化股票<br>发起式 A                                       | 银华食品饮料量化股<br>票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 005235  | 005236              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 66,618,318.43 份   | 38,386,127.72 份     |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021年1月1日—2021年3月31日） |                     |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
|                 | 银华食品饮料量化股票发起<br>式 A       | 银华食品饮料量化股票发<br>起式 C |
| 1. 本期已实现收益      | 9,418,206.27              | 5,727,013.32        |
| 2. 本期利润         | -13,971,304.59            | -8,076,420.29       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1817                   | -0.1738             |
| 4. 期末基金资产净值     | 157,124,255.34            | 89,838,609.23       |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.3586                    | 2.3404              |

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 银华食品饮料量化股票发起式 A

| 阶段        | 净值增长<br>率① | 净值增长<br>率标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-----------|------------|---------------|----------------|-------------------|-------|-------|
| 过去三个<br>月 | -6.20%     | 2.40%         | -9.64%         | 2.24%             | 3.44% | 0.16% |
| 过去六个      | 18.31%     | 1.98%         | 11.89%         | 1.88%             | 6.42% | 0.10% |

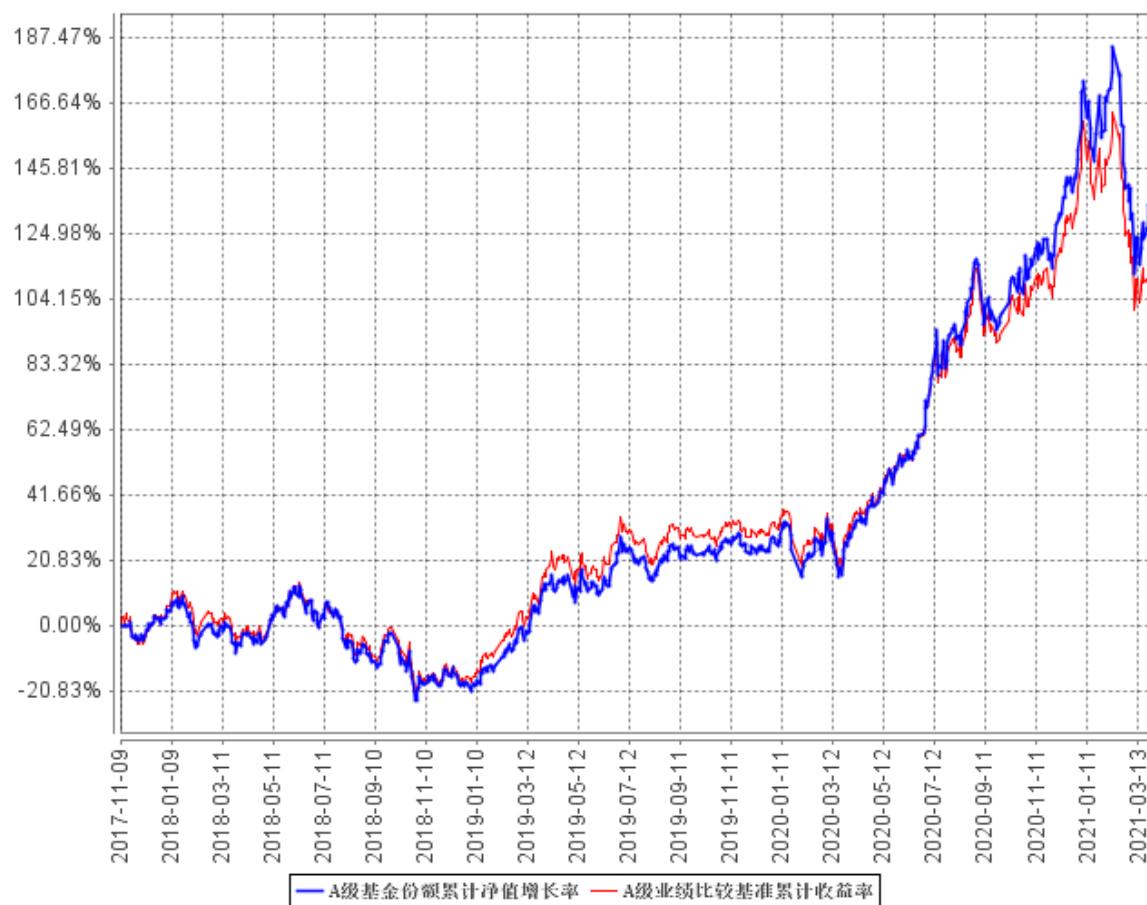
| 月                  |         |       |         |       |        |       |
|--------------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一年               | 82.62%  | 1.79% | 63.97%  | 1.72% | 18.65% | 0.07% |
| 过去三年               | 150.75% | 1.72% | 124.45% | 1.67% | 26.30% | 0.05% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 135.86% | 1.68% | 116.49% | 1.65% | 19.37% | 0.03% |

## 银华食品饮料量化股票发起式 C

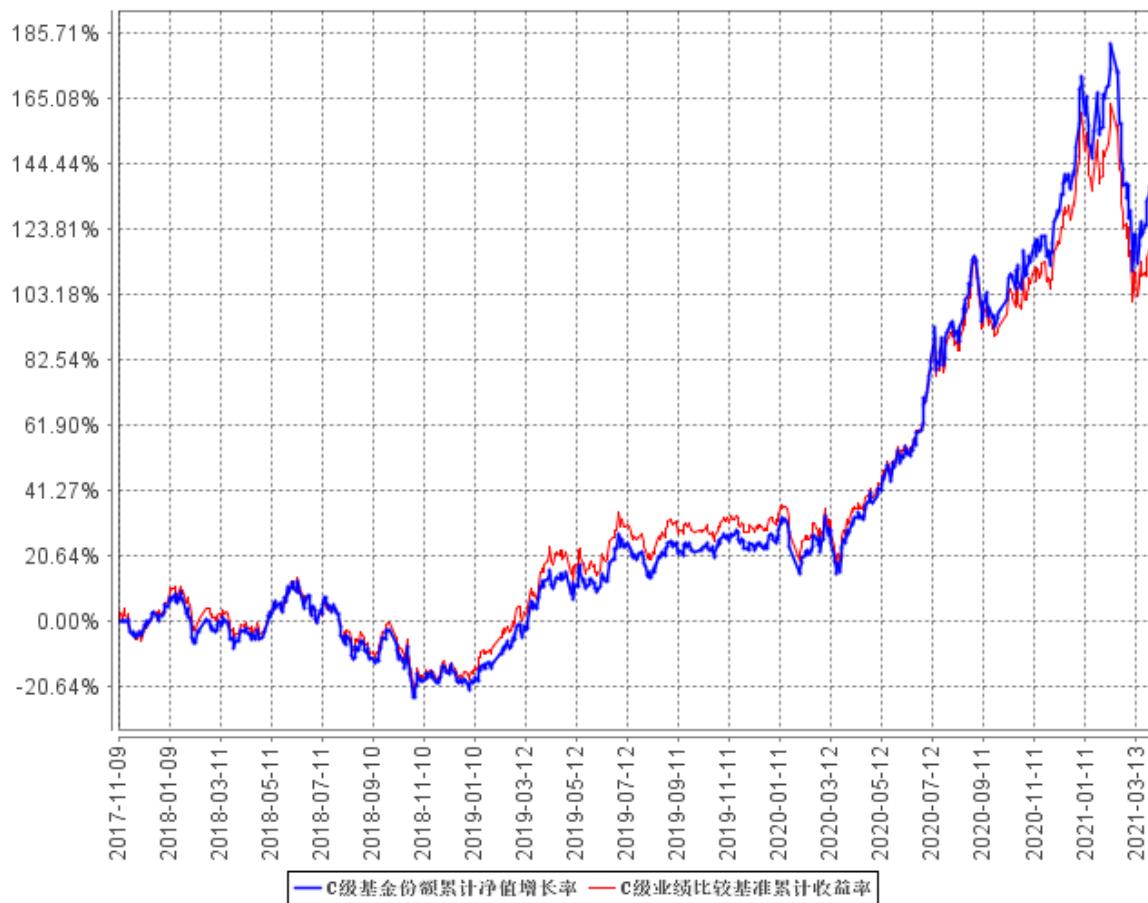
| 阶段                 | 净值增长<br>率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|--------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个<br>月          | -6.29%     | 2.40%         | -9.64%         | 2.24%             | 3.35%  | 0.16% |
| 过去六个<br>月          | 18.08%     | 1.98%         | 11.89%         | 1.88%             | 6.19%  | 0.10% |
| 过去一年               | 81.91%     | 1.79%         | 63.97%         | 1.72%             | 17.94% | 0.07% |
| 过去三年               | 148.56%    | 1.72%         | 124.45%        | 1.67%             | 24.11% | 0.05% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 134.04%    | 1.68%         | 116.49%        | 1.65%             | 17.55% | 0.03% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A 级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



### C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于食品饮料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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名    | 职务              | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-------|-----------------|------------------|------|--------|---|
|       |                 | 任职日期             | 离任日期 |        |   |
| 李宜璇女士 | 本 基 金 的 基 金 经 球 | 2020 年 10 月 29 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。 |
| 马君女士 | 本基金的基金经理 | 2017 年 11 月 9 日 | 2021 年 2 月 25 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基金经理 |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | (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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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。

#### 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管理办法》及其各项实施准则、《银华食品饮料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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件。除此之外运用自行开发的量化投资模型，精选细分子行业个股，力争实现超越行业的阿尔法收益。

2021 年一季度中，随着疫苗接种逐步铺开，新冠疫情的阴影正在全球范围内逐步减弱。国内方面，春节期间的人口流动没有产生新的疫情反复，疫情防控依然维持在良好水平；国外方面，随着疫苗产能逐步上升，接种覆盖率增加，疫情扩散程度得到了较好的控制。在此背景下，全球经济复苏的预期有所上升，这在利率、贵金属等资产价格的波动上有所反应。这种波动也反过来对权益市场的估值产生了一定的影响。A 股市场在一季度中波动加大，且风格呈现转换：大消费类行业出现调整，而周期资源类行业估值提升。作为大消费板块的代表性行业，食品饮料在年初经历了一波估值快速上行后，在后半季度中则明显调整。

展望二季度我们认为，疫情复苏的确定性将逐步增强，这对于市场的作用将是多方面的。一方面，复苏、通胀的预期提升，可能会对权益市场的估值逻辑产生影响，进而使市场的波动性增加；但另一方面，回归本源来看，需求的增加、全球经济逐步回归常态化，也将继续对产业链正常化、贸易出口正常化提供支撑。在这一背景下，食品饮料作为消费板块龙头，将持续受益于经济常态化和消费升级化，具有良好的基本面预期，仍将存在投资机会。在此过程中，我们持续看好行业龙头公司的超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式 A 基金份额净值为 2.3586 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.20%；截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式 C 基金份额净值为 2.3404 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.29%，同期业绩比较基准收益率为 -9.64%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

### S5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目    | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资  | 228,756,353.35 | 91.09        |
|    | 其中：股票 | 228,756,353.35 | 91.09        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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      | 18,705,468.15  | 7.45   |
| 8 | 其他资产              | 3,660,783.61   | 1.46   |
| 9 | 合计                | 251,122,605.11 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 228,043,211.60 | 92.34        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12      | 0.01         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 617,895.82     | 0.25         |
| 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  | 45,878.59      | 0.02         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 8,167.50       | 0.00         |
| 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    | 17,163.72      | 0.01         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 228,756,353.35 | 92.63        |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 10,907  | 21,912,163.00 | 8.87         |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 96,496  | 21,713,529.92 | 8.79         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 78,070  | 20,921,198.60 | 8.47         |
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 58,874  | 19,593,267.20 | 7.93         |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 325,181 | 13,016,995.43 | 5.27         |
| 6  | 002304 | 洋河股份 | 75,065  | 12,363,205.50 | 5.01         |
| 7  | 603369 | 今世缘  | 219,818 | 10,782,072.90 | 4.37         |
| 8  | 600298 | 安琪酵母 | 188,720 | 10,424,892.80 | 4.22         |
| 9  | 002568 | 百润股份 | 93,735  | 10,217,115.00 | 4.14         |
| 10 | 603589 | 口子窖  | 161,398 | 10,006,676.00 | 4.05         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 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。

### 5.10 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 86,827.51    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,599,559.02 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,410.70     |
| 5  | 应收申购款   | 1,971,986.38 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,660,783.61 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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情况的说明。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 银华食品饮料量化股票发起式 A | 银华食品饮料量化股票发起式 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 68,512,768.16   | 45,482,259.78   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 76,250,897.05   | 48,345,740.61   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 78,145,346.78   | 55,441,872.67   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额               | 66,618,318.43   | 38,386,127.72   |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占<br>基金总份额<br>比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 (%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|---------------|--------------------------|---------------|--------------------------|----------------|
| 基金管理人固有<br>资金   | 10,003,000.30 | 9.53                     | 10,003,000.30 | 9.53                     | 3 年            |
| 基金管理人高级<br>管理人员 | -             | -                        | -             | -                        | -              |
| 基金经理等人员         | -             | -                        | -             | -                        | -              |
| 基金管理人股东         | -             | -                        | -             | -                        | -              |
| 其他              | -             | -                        | -             | -                        | -              |
| 合计              | 10,003,000.30 | 9.53                     | 10,003,000.30 | 9.53                     | 3 年            |

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,003,000.30 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 3,000.30 份。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 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 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 10.1.1 银华食品饮料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
- 10.1.2 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 10.1.3 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- 10.1.4 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》
- 10.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 10.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 10.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 10.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

## 10.2 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。

## 10.3 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 4 月 21 日