

银华可转债债券型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 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

报告送出日期：2022 年 1 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 2022 年 1 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 银华可转债债券 |
| 基金主代码 | 005771 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 8 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 611,533,168.73 份 |
| 投资目标 | 本基金通过对可转换债券的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将采用定量和定性相结合的分析方法，结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。</p> <p>本基金投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合财富（总值）指数收益率*15%+沪深 300 指数收益率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为可转换债券主题的债券型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和普通债券型基金。 |
| 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 |
|-------|--------------|

§ 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 38,540,504.36 |
| 2. 本期利润 | 85,611,735.09 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1917 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,145,120,662.11 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.8725 |

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。

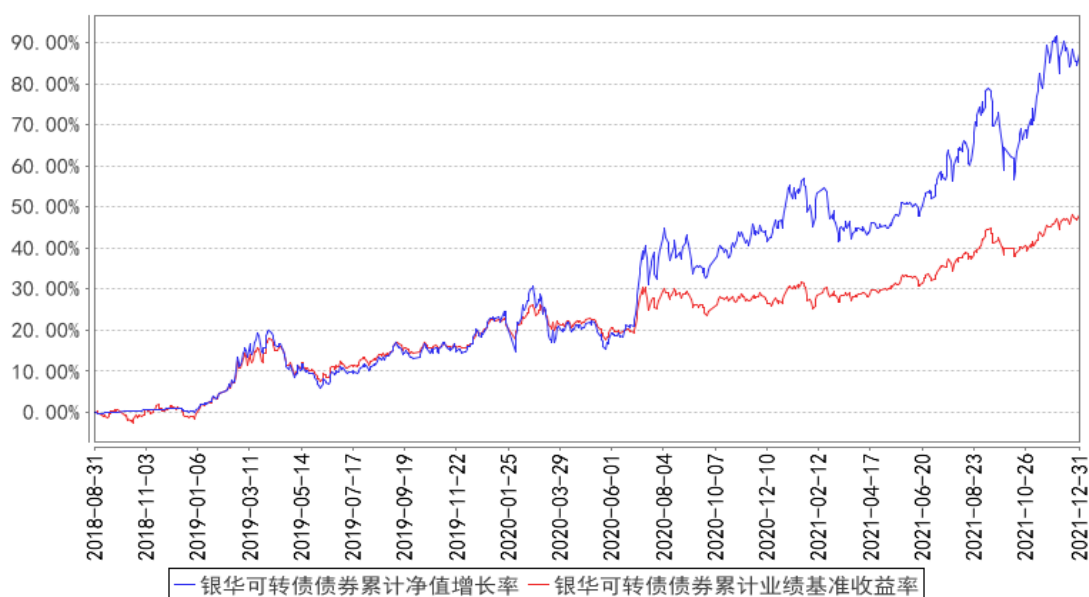
3.2 基金净值表现

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

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 13.93% | 1.25% | 5.89% | 0.45% | 8.04% | 0.80% |
| 过去六个月 | 21.52% | 1.34% | 11.18% | 0.52% | 10.34% | 0.82% |
| 过去一年 | 25.76% | 1.15% | 15.20% | 0.49% | 10.56% | 0.66% |
| 过去三年 | 86.93% | 1.03% | 49.64% | 0.59% | 37.29% | 0.44% |
| 自基金合同 生效起至今 | 87.25% | 0.97% | 48.05% | 0.57% | 39.20% | 0.40% |

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

银华可转债债券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为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易可转债）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（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 | | |
| 孙慧女士 | 本基金的基金经理 | 2018年8月31日 | - | 11.5年 | 硕士学位。2010年6月至2012年6月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012年7月至2015年2月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理；2015年3月加盟银华基金管理有限公司，历任基金经理助理。自2016年2月6日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年5月21日兼任银华增利证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年10月16日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年10月17日至2018年2月5日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 金基金经理,自 2016 年 10 月 17 日至 2018 年 6 月 26 日兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理,自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理,自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理,自 2018 年 8 月 31 日起兼任银华可转债债券型证券投资基金基金经理,自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理,自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。 |
|--|--|--|--|--|--|

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华可转债债券型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 报告期内基金的投资策略和运作分析

操作回顾：

2021 年 4 季度，国内外宏观经济环境更趋复杂。海外主要发达国家在通胀压力的超预期持续下，货币紧缩进程有所加快。国内则随着经济压力逐渐显性化，“稳增长”重新成为阶段性政策重心，财政与货币政策均趋于宽松，节奏前值。权益市场方面，市场风格再次出现变化，供给驱动的价格型板块快速回调，前期受到压制的中游制造业企稳反弹，同时消费板块也通过提价向下游传导成本压力，板块修复式上涨。数个新的赛道再次成为市场关注热点，汽车电子、元宇宙、军工、农业在 4 季度表现强势。临近年底，逆周期预期也逐步强化，地产、金融、建筑建材等相继企稳反弹。债券市场方面，在 10 月经历短暂调整后，随着经济放缓与货币宽松趋势的不断确认，叠加微观层面配置需求的释放，收益率总体在 4 季度再下一个台阶，期限利差、信用利差、品种利差均继续压缩至较低水平。转债市场方面，在权益结构性机会与债券低机会成本的共同作用下，估值水平不断拉升至历史高位，个券机会层出不穷的同时，整体波动性也在加大。

4 季度，本基金保持稳健均衡的配置结构，重点持有长期业绩良好，同时转债及正股估值合理的个券，力求实现中长期稳健净值回报。

市场展望：

对于转债市场来讲，当前估值处于历史新高区域，性价比有一定程度下降。造成这样的估值水平有很多原因，市场已经进行了较为充分的讨论，包括利率水平系统性降低、流动性水平较为充裕、固收+产品的发展以及信用违约事件的频繁发生。经验来讲，估值何时收敛以及收敛到什么水平是较难预判的。一般来说，有三个标志：一是纯债收益率大幅上行，二是资金面持续紧张，

三是股票市场下跌。转债市场的整体估值一般很难通过股票的上涨来实现，因为估值就是情绪指标，股票上涨的时候估值很难有效压缩。对于估值高企的情况，应对重于预测。应对策略来讲，一是控制风险敞口，目前转债仓位接近下限运作；二是均衡配置，不仅仅在行业以及个券层面，在组合特征层面也要进行一定的均衡，比如尽量降低双高品种的占比；三是注重收益的兑现。今年转债指数表现较好，也是多重利好的兑现，一是周期占比较大；二是中小盘成长比重大；三是新能源等板块发行转债较多。明年股票市场的风格可能更加均衡，立足于明年，转债市场的超额收益仍然来自于结构性机会的挖掘。

1 季度，本基金将继续坚持稳健均衡的配置思路，仍以正股基本面扎实、长期业绩预期良好的转债个券为主，同时兼顾估值与流动性水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.8725 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.93%，业绩比较基准收益率为 5.89%。

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。

§ 5 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 | 225,670,032.72 | 17.10 |
| | 其中：股票 | 225,670,032.72 | 17.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 983,815,439.57 | 74.53 |
| | 其中：债券 | 983,815,439.57 | 74.53 |
| | 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 | 40,770,000.00 | 3.09 |
| | 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 | 25,284,116.26 | 1.92 |
| 8 | 其他资产 | 44,430,048.08 | 3.37 |
| 9 | 合计 | 1,319,969,636.63 | 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 | 201,177,133.72 | 17.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,619,127.00 | 1.19 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,001,500.00 | 0.17 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,061,420.00 | 0.44 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,810,852.00 | 0.33 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 225,670,032.72 | 19.71 |

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 6,869 | 14,081,450.00 | 1.23 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 59,800 | 13,315,068.00 | 1.16 |
| 3 | 300558 | 贝达药业 | 136,300 | 10,880,829.00 | 0.95 |
| 4 | 688198 | 佰仁医疗 | 42,160 | 10,721,288.00 | 0.94 |
| 5 | 002179 | 中航光电 | 98,600 | 9,915,216.00 | 0.87 |
| 6 | 300813 | 泰林生物 | 92,898 | 9,289,800.00 | 0.81 |
| 7 | 000768 | 中航西飞 | 249,917 | 9,121,970.50 | 0.80 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 100,213 | 8,638,360.60 | 0.75 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 14,377 | 8,453,676.00 | 0.74 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 10 | 600905 | 三峡能源 | 1,095,400 | 8,226,454.00 | 0.72 |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 57,216,321.60 | 5.00 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,151,210.60 | 0.19 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,151,210.60 | 0.19 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 924,447,907.37 | 80.73 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 983,815,439.57 | 85.91 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 123111 | 东财转 3 | 472,670 | 79,493,640.60 | 6.94 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 503,640 | 59,610,830.40 | 5.21 |
| 3 | 019641 | 20 国债 11 | 452,440 | 45,357,110.00 | 3.96 |
| 4 | 113048 | 晶科转债 | 237,310 | 42,730,038.60 | 3.73 |
| 5 | 113534 | 鼎胜转债 | 160,570 | 42,241,149.90 | 3.69 |

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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 115,605.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | 39,606,970.82 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,181,840.07 |
| 5 | 应收申购款 | 2,525,631.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 44,430,048.08 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 123111 | 东财转 3 | 79,493,640.60 | 6.94 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 59,610,830.40 | 5.21 |
| 3 | 113048 | 晶科转债 | 42,730,038.60 | 3.73 |
| 4 | 113534 | 鼎胜转债 | 42,241,149.90 | 3.69 |
| 5 | 123071 | 天能转债 | 35,974,060.10 | 3.14 |
| 6 | 110073 | 国投转债 | 28,012,630.80 | 2.45 |
| 7 | 113563 | 柳药转债 | 23,928,991.20 | 2.09 |
| 8 | 113549 | 白电转债 | 23,868,921.20 | 2.08 |
| 9 | 123022 | 长信转债 | 23,116,473.18 | 2.02 |
| 10 | 128035 | 大族转债 | 22,059,672.60 | 1.93 |
| 11 | 123099 | 普利转债 | 21,967,122.71 | 1.92 |
| 12 | 113623 | 凤 21 转债 | 21,360,139.00 | 1.87 |
| 13 | 123075 | 贝斯转债 | 19,692,003.20 | 1.72 |
| 14 | 123084 | 高澜转债 | 18,131,708.70 | 1.58 |
| 15 | 123070 | 鹏辉转债 | 17,583,849.60 | 1.54 |
| 16 | 113013 | 国君转债 | 17,077,590.30 | 1.49 |
| 17 | 123114 | 三角转债 | 16,630,843.98 | 1.45 |
| 18 | 128135 | 洽洽转债 | 16,034,452.50 | 1.40 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 19 | 113025 | 明泰转债 | 15,765,024.00 | 1.38 |
| 20 | 118000 | 嘉元转债 | 13,426,593.30 | 1.17 |
| 21 | 113605 | 大参转债 | 13,159,382.90 | 1.15 |
| 22 | 127038 | 国微转债 | 12,932,027.22 | 1.13 |
| 23 | 113537 | 文灿转债 | 12,488,776.30 | 1.09 |
| 24 | 127025 | 冀东转债 | 12,070,870.23 | 1.05 |
| 25 | 127026 | 超声转债 | 11,824,267.93 | 1.03 |
| 26 | 113616 | 韦尔转债 | 11,816,411.70 | 1.03 |
| 27 | 110075 | 南航转债 | 11,525,905.00 | 1.01 |
| 28 | 128095 | 恩捷转债 | 11,460,941.90 | 1.00 |
| 29 | 127027 | 靖远转债 | 11,426,705.22 | 1.00 |
| 30 | 113582 | 火炬转债 | 11,182,629.10 | 0.98 |
| 31 | 123090 | 三诺转债 | 11,129,028.24 | 0.97 |
| 32 | 123104 | 卫宁转债 | 10,015,451.04 | 0.87 |
| 33 | 127006 | 敖东转债 | 9,916,614.00 | 0.87 |
| 34 | 123046 | 天铁转债 | 8,781,999.00 | 0.77 |
| 35 | 123107 | 温氏转债 | 8,449,748.00 | 0.74 |
| 36 | 110056 | 亨通转债 | 6,942,380.50 | 0.61 |
| 37 | 127037 | 银轮转债 | 6,113,769.20 | 0.53 |
| 38 | 128134 | 鸿路转债 | 5,596,140.30 | 0.49 |
| 39 | 123092 | 天壕转债 | 3,382,916.70 | 0.30 |

5.10.5 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。

5.10.6 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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 304,592,474.55 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 413,073,551.98 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 106,132,857.80 |
| 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 | 611,533,168.73 |

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 12 月 24 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2021 年 12 月 24 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 银华可转债债券型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 9.1.2 《银华可转债债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《银华可转债债券型证券投资基金招募说明书》
- 9.1.4 《银华可转债债券型证券投资基金托管协议》
- 9.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 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。

9.3 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

2022 年 1 月 21 日